

短期市場の推移

	10月12日	10月13日	10月14日	10月15日
加重平均金利	▲0.016	▲0.020	▲0.020	▲0.014
東京レポレート(ON)	▲0.064	▲0.069	▲0.078	▲0.081
無コール残	81,742	81,831	88,045	84,067
ON	44,754	46,313	52,597	50,574
その他	36,988	35,518	35,448	33,493
有コール残	20,751	19,828	19,266	20,601

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの。無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

10月19日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	9月貿易収支	9807億円	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.080	0.001	▲0.033	▲0.083
T/N	-	-	▲0.001	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.015	▲0.022	▲0.083
2W	▲0.030	▲0.010	▲0.023	▲0.086
3W	-	-	0.030	▲0.090
1M	▲0.035	0.200	▲0.013	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.138
1Y	-	-	-	▲0.161

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.015%の水準で出合が見られた。新積み期に入り調達を様子見る先もあり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.019%の▲0.033%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.050	▲0.055 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は旺盛で、堅調な地合を想定。

資金需給

	日銀速報 10月16日	日銀予想 10月19日	当社需給予想 10月20日
券	+0	▲200	+0
財政	+1,100	▲14,400	▲19,000
過不足	+1,100	▲14,600	▲19,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)		▲2,300	+2,800
CP等買入	▲300	▲300	
社債等買入	▲200		
被災地金融機関支援	▲100	+100	
国債補完供給	▲100	+100	
当座預金増減	+500	▲14,300	▲19,000
当座預金残高	4,869,100	4,854,800	4,835,800
準備預金残高	4,246,900	主な需給要因	
積み終了先	4,229,600		
超過準備	3,073,500		
非準備預金残高	622,200	国庫短期証券	国庫短期証券
準備預金進捗率	99.5%	発行・償還(3M)	発行・償還(1Y)
平均	9.7%		
乖離率	89.8%		

10月16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(10/16~10/19)	140	140	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
共通担保(全店)(10/19~11/2)	20,000	2,801	2,801			

マナタリーベース [億円]
10月15日時点 6,052,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,537,500
10月19日以降の残り所要積数 17,100
平均 600

国庫短期証券入札予定

10月19日	1年	第945回
10月22日	6ヶ月	第946回
10月23日	3ヶ月	第947回
10月30日	3ヶ月	
10月20日	20年	
10月27日	2年	
11月4日	10年	
11月6日	物価連動	

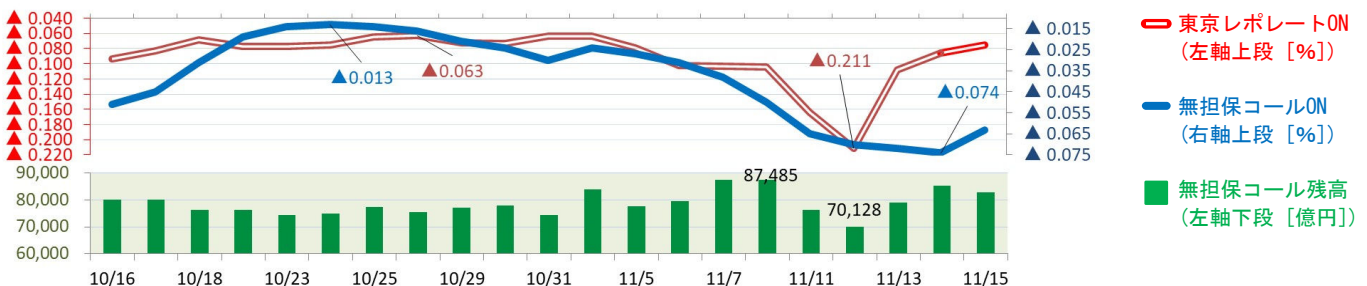
今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	500~1,500	1,000	月3回程度	10月9日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 26 30	10月14日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	10月14日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 30	10月14日	2
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 26	10月2日	1
25年超	0~500	300	9 26	10月9日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	10月14日	1
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	0

1年前の市場推移

○2019年10月積み期 [10月16日~11月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。