

短期市場の推移

	10月15日	10月16日	10月19日	10月20日
加重平均金利	▲0.014	▲0.033	▲0.031	▲0.022
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.083	▲0.074	▲0.075
無コール残	84,067	105,812	99,435	103,217
ON	50,574	72,189	62,822	64,859
その他	33,493	33,623	36,613	38,358
有コール残	20,601	20,932	21,053	21,944

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22日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (10月20日現在)	21:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分]
14:00	9月の全国百貨店売上高 (百貨店協会)	23:00	(米)9月景気先行指数
			0.8%

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	▲0.070	0.001	▲0.019	▲0.076
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.013	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.012	▲0.018	▲0.085
2W	▲0.015	▲0.001	▲0.011	▲0.087
3W	-	-	0.030	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.136
1Y	-	-	-	▲0.160

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▲0.030%~▲0.010%の水準で出合が見られた。地合いは昨日より強含み、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.019%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達スタンスに大きな変化はなく、引き続き堅調な地合を予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月21日	10月22日	10月23日
券	▲700	▲1,600	▲1,000
財政	▲12,800	+2,700	+17,000
過不足	▲13,500	+1,100	+16,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+20,000
国債買入			+12,600
CP等買入	▲200	▲200	
社債等買入			+2,000
国債補完供給	▲100	+100	
当座預金増減	▲13,800	+35,600	+16,000
当座預金残高	4,820,100	4,855,700	4,871,700
準備預金残高	4,208,400	主な需給要因	
積み終了先	4,206,300		
超過準備	4,206,000		
非準預先残高	611,700		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	19.4%		
乖離率	80.5%		

10月21日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(10/22~)	20,000	50,852	20,002	0.007	0.011	59.0
国債買入(10/22~)						
1~3年	4,200	13,035	4,201	0.005	0.005	97.2
3~5年	3,500	13,815	3,509	0.003	0.003	51.9
5~10年	4,200	13,330	4,210	0.003	0.004	76.0
物価連動	300	1,170	301	▲0.110	▲0.199	38.1
国債補完供給(10/21~10/22)						
		102	102	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月20日時点 6,018,200	今積期の所要準備額 3,537,500
	10月22日以降の残り所要積数 5,400
	平均 200

国庫短期証券入札予定

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
11月6日 3ヶ月
国債入札予定
10月27日 2年
11月4日 10年
11月6日 物価連動
11月10日 30年

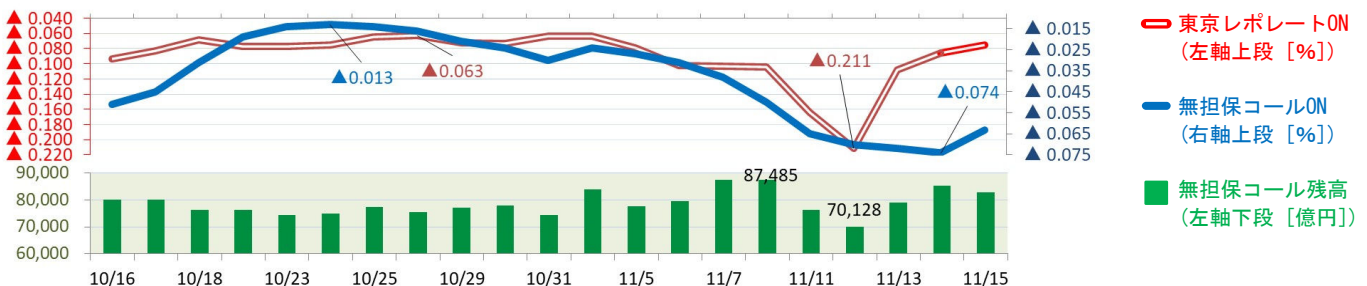
今月の国債買入オペ予定

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21日	2
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	10月21日	2
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 30	10月21日	1
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21日	0
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。