

短期市場の推移

	10月22日	10月23日	10月26日	10月27日
加重平均金利	▲0.017	▲0.012	▲0.016	▲0.019
東京レポレート(ON)	▲0.090	▲0.091	▲0.078	▲0.078
無コール残	112,094	120,976	110,951	98,993
ON	69,691	69,713	60,038	55,980
その他	42,403	51,263	50,913	43,013
有コール残	19,374	20,425	19,544	21,282

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29日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10月1日銀金融政策 決定会合(2日目)	-	21:30	(米)7-9月期国内総生産 (GDP)速報値[前期比年 率]
黒田総裁記者会見	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.065	0.001	▲0.024	▲0.084
T/N	▲0.008	▲0.001	▲0.003	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.025	▲0.032	▲0.091
2W	▲0.025	0.001	▲0.020	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	▲0.015	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.112
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.158

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▲0.02%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.01%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)前営業日対比▲0.005%の▲0.024%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.035 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

本日対比で出合の水準は小幅下落を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月28日	10月29日	10月29日	10月30日	10月30日	10月31日
券	▲500	▲800	▲800	▲500	▲500	▲500
財政	+2,400	+700	+700	+900	+900	+900
過不足	+1,900	▲100	▲100	▲1,400	▲1,400	▲1,400
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国庫短期証券買入	+25,000					
CP等買入	▲200	▲200	▲200	+6,000		
ETF買入	+200					
国債補完供給	+200	▲300	+300			
当座預金増減	+26,800	+6,000	+6,000	▲1,400	▲1,400	▲1,400
当座預金残高	4,891,100	4,897,100	4,897,100	4,895,700	4,895,700	4,895,700
準備預金残高	4,288,300	主な需給要因				
積み終了先	4,288,000					
超過準備	4,288,000					
非準預先残高	602,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	41.9%					
乖離率	58.0%					

10月28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(10/28~10/29)	334	334	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
10月27日時点 6,051,900

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,537,500
10月29日以降の残り所要積数	1,300
平均	100

国庫短期証券入札予定

10月30日	3ヶ月	第948回
11月6日	3ヶ月	
11月9日	6ヶ月	
11月13日	3ヶ月	
国債入札予定		
11月4日	10年	
11月6日	物価運動	
11月10日	30年	
11月12日	5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26日	1
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	10月26日	1
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26日	0
25年超	0~500	300	9 26	10月26日	0
物価運動債	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。