

短期市場の推移

	10月23日	10月26日	10月27日	10月28日
加重平均金利	▲0.012	▲0.016	▲0.019	▲0.024
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.078	▲0.078	▲0.084
無コール残	120,976	110,951	98,993	107,088
ON	69,713	60,038	55,980	62,575
その他	51,263	50,913	43,013	44,513
有コール残	20,425	19,544	21,282	18,613

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30日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	9月有効求人倍率	1.03倍	21:30 (米)9月個人消費支出	1.0%
8:30	9月失業率	+3.1%	-	-
14:00	経済・物価情勢の展望(10月、全文)	-	-	-

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	▲0.026	▲0.091
T/N	▲0.030	▲0.001	▲0.015	▲0.100
S/N	-	-	▲0.025	-
1W	▲0.040	▲0.013	▲0.023	▲0.094
2W	▲0.020	0.001	▲0.007	▲0.093
3W	▲0.030	0.001	▲0.009	▲0.093
1M	▲0.020	0.040	0.000	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
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▲0.002%の▲0.026%となった。
本日結果が公表された金融政策決定会合では政策の現状維持が決定された。

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

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるため本日対比で小幅上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月29日	10月30日	10月30日	10月31日	11月2日
券	▲900	▲500	▲500	▲500	+0
財政	+300	▲200	▲200	▲200	▲26,000
過不足	▲600	▲700	▲700	▲700	▲26,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)					
CP等買入	▲200	+6,000	▲4,700	▲4,700	▲2,800
社債等買入			▲100	▲100	
ETF買入				+700	
国債補完供給	+300	▲200	+200		
当座預金増減	+5,300	▲4,600	▲4,600	▲4,600	▲28,800
当座預金残高	4,896,400	4,891,800	4,891,800	4,891,800	4,863,000
準備預金残高	4,279,200				
積み終了先	4,278,900				
超過準備	4,278,900				
非準備先残高	617,200				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	45.2%				
乖離率	54.7%				

10月29日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接点
国債補完供給(10/29~10/30)	228	228	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
10月28日時点 6,079,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,537,500
10月30日以降の残り所要積数 1,000
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	
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。