

短期市場の推移

	10月1日	10月2日	10月3日	10月4日
加重平均金利	▲0.048	▲0.036	▲0.019	▲0.011
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.073	▲0.052	▲0.049
無コール残	77,448	78,799	74,650	87,025
ON	56,643	58,194	52,010	63,065
その他	20,805	20,605	22,640	23,960
有コール残	21,082	21,376	20,075	20,585

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。

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	▲0.040	0.001	▲0.012	▲0.046
T/N	-	-	-	▲0.046
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.001	▲0.007	▲0.052
2W	-	-	▲0.020	▲0.064
3W	-	-	0.000	▲0.072
1M	-	-	▲0.015	▲0.085
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.020	▲0.166
6M	-	-	-	▲0.184
1Y	-	-	-	▲0.201

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

10月8日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	8月国際収支(経常収支)	21081億円	21:30	(米)9月生産者物価コア指数[前年比]
	-	-		2.4%
	-	-		パウエルFRB議長の講演
	-	-		-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%～▲0.005%の水準で取引された。先週末に引き続き、資金調達ニーズは旺盛であり、堅調な地合となった。同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.001%の▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

明日も地合いは堅調で、出会いの水準は横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月7日	10月8日	10月9日
券	+900	+600	+0
財政	+5,200	▲500	▲4,000
過不足	+6,100	+100	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+4,600	+9,300	スタート
共通担保(全店)	▲3,100	+1,600	
CP等買入	▲100	▲300	
国債補完供給	+900	▲200	+200
当座預金増減	+9,800	+9,300	▲4,000
当座預金残高	4,005,200	4,014,500	4,010,500
準備預金残高	3,488,700	主な需給要因	
積み終了先	3,488,500		
超過準備	3,488,500		
非準備預金残高	516,500		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	73.3%		
乖離率	26.6%		

10月7日のオペ結果 [元][億円]※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(10/8~)						
1~3年	4,200	14,669	4,204	0.002	0.003	86.8
3~5年	3,400	8,259	3,401	▲0.009	▲0.007	40.1
10~25年	1,200	4,731	1,203	0.000	0.000	99.1
25年~	300	1,253	301	0.003	0.004	27.9
国債補完供給(10/7~10/8)						
		210	210	▲0.250	▲0.250	

マネタリーベース [億円]
10月4日時点 5,114,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,090,800
10月8日以降の残リ所要
積数 1,100
平均 100

国庫短期証券入札予定

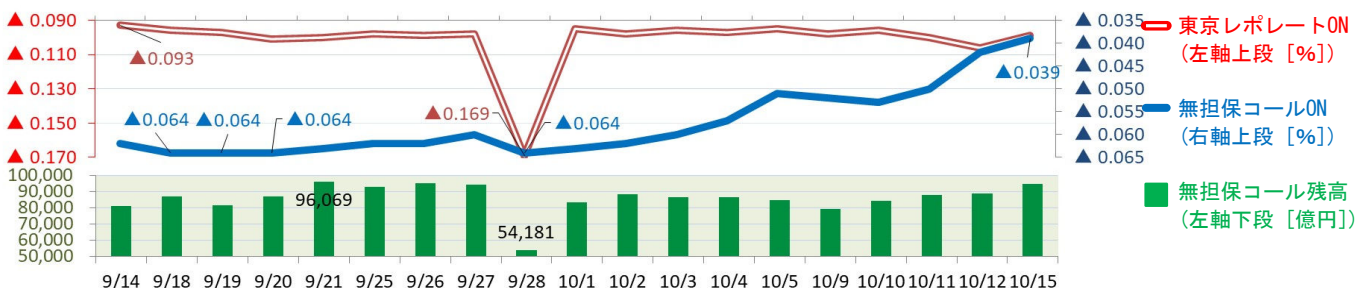
10月9日 6ヶ月 第862回
10月11日 3ヶ月 第863回
10月17日 1年
10月18日 3ヶ月
国債入札予定
10月10日 30年
10月17日 5年
10月24日 20年
10月29日 2年

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	100~1,000 程度	4,200	月2回程度	10月4日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	5,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 15 21 28	10月7日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	4 15 21 28	10月4日	3
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	7 18 30	10月7日	2
25年超	0~500 程度	300			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	10月4日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	1

1年前の市場推移 ○2018年9月積み期 [9月14日~10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。