

短期市場の推移

	10月2日	10月3日	10月4日	10月7日
加重平均金利	▲0.036	▲0.019	▲0.011	▲0.012
東京レポレート(ON)	▲0.073	▲0.052	▲0.049	▲0.046
無コール残	78,799	74,650	87,025	75,741
ON	58,194	52,010	63,065	52,766
その他	20,605	22,640	23,960	22,975
有コール残	21,376	20,075	20,585	19,700

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9日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
工作機械受注額速報(9月)		20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
-			(米)FOMC議事要旨の公表
-			-

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	▲0.012	▲0.050
T/N	-	-	-	▲0.057
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.000	▲0.009	▲0.060
2W	-	-	-	▲0.070
3W	-	-	▲0.010	▲0.077
1M	-	-	-	▲0.089
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.045	▲0.168
6M	-	-	-	▲0.186
1Y	-	-	-	▲0.205

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▲0.010%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。昨日に引き続き、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)は前日対比横ばいの▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.010	▲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、出合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8日	10月9日	10月8日	10月9日	10月10日	10月11日
券	+500	+600			▲1,000	▲1,000
財政	▲3,900	▲3,300			▲4,000	▲4,000
過不足	▲3,400	▲2,700			▲5,000	▲5,000
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				+1,000		
国債買入	+9,300					
CP等買入	▲300	▲200				
ETF買入		+100				
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減	+5,700	▲1,700			▲5,000	
当座預金残高	4,010,900	4,009,200			4,004,200	
準備預金残高	3,493,800					
積み終了先	3,493,600					
超過準備	3,493,600					
非準備先残高	517,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	76.7%					
乖離率	23.2%					

10月8日のオペ結果 [%][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	接分
国庫短期証券買入(10/9~)	1,000	4,735	1,000	0.016	0.016	
米ドル資金供給(10/10~10/18)	0	0	2,340	2,340		
国債補完供給(10/8~10/9)	52	52	▲0.250	▲0.250		
	4	4	▲0.250	▲0.250		

マナタリーベース [億円]
10月7日時点 5,123,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,090,800
10月9日以降の残り所要積数 900
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	

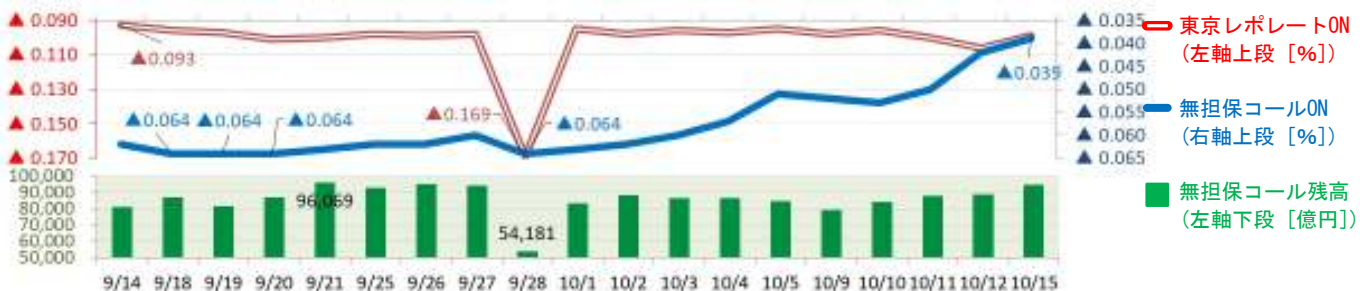
今月の国債買入オペ予定

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	500	月2回程度	10月4日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
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			
25年超	0~500 程度	300	7 18 30	10月7日	2
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。