

2019年10月11日(金)

### 短期市場の推移

[億円] [%]

	10月7日	10月8日	10月9日	10月10日
加重平均金利	▲0.012	▲0.012	▲0.012	▲0.011
東京レポレート(ON)	▲0.046	▲0.050	▲0.064	▲0.052
無コール残	75,741	82,323	78,791	79,320
ON	52,766	59,673	56,011	56,495
その他	22,975	22,650	22,780	22,825
有コール残	19,700	19,936	18,137	18,191

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	▲0.060	0.001	▲0.010	▲0.054
T/N	-	-	-	▲0.076
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.001	▲0.017	▲0.082
2W	-	-	0.000	▲0.083
3W	-	-	▲0.020	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.168
6M	-	-	-	▲0.181
1Y	-	-	-	▲0.196

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15日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
9:30頃	【挨拶】黒田総裁(支店長会議)	-	21:30	(米)10月ニューヨーク連銀製造業景気指数
10:00	営業毎旬報告(10月10日現在)	-		(米)セントルイス連銀総裁の講演
14:00	地域経済報告(10月)	-		(米)サンフランシスコ連銀総裁の講演

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▲0.015%~▲0.005%の水準で取引された。週末4日積みとなることから資金調達ニーズは昨日よりも強く同加重平均金利(速報)は▲0.010%と、2016年4月以来3年半ぶりの高値となった。

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

### 翌営業日のマーケット

週明けも旺盛な調達ニーズは継続し、地合いは横ばいと予想。

### 資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月11日	10月15日	10月16日
券	▲900	+500	+0
財政	▲8,100	+81,400	+1,000
過不足	▲9,000	+81,900	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲400	▲2,200	▲2,200
CP等買入		▲500	
ETF買入	+700		
当座預金増減	▲8,700	+81,400	+1,000
当座預金残高	3,992,600	4,074,000	4,075,000
準備預金残高	3,471,400	主な需給要因	
積み終了先	3,471,300	国庫短期証券	
超過準備	3,471,300	発行・償還(3M)	
非準備預金残高	521,200	国債発行	
準備預金進捗率	99.9%	(2年・個人向け)	
平均	96.7%	源泉税揚げ	
乖離率	3.2%	年金定時払い	

### 10月11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	按分
CP等買入(10/17~)	2,500	8,099	2,485	▲0.001	0.004	17.0
国債補完供給(10/11~10/15)		0	0			
共通担保(全店)(10/15~10/28)	15,000	2,168	2,168			

マネタリーベース [億円]  
10月10日時点 5,119,600

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,090,800  
10月15日以降の残リ所要  
積数 100  
平均 100

### 国庫短期証券入札予定

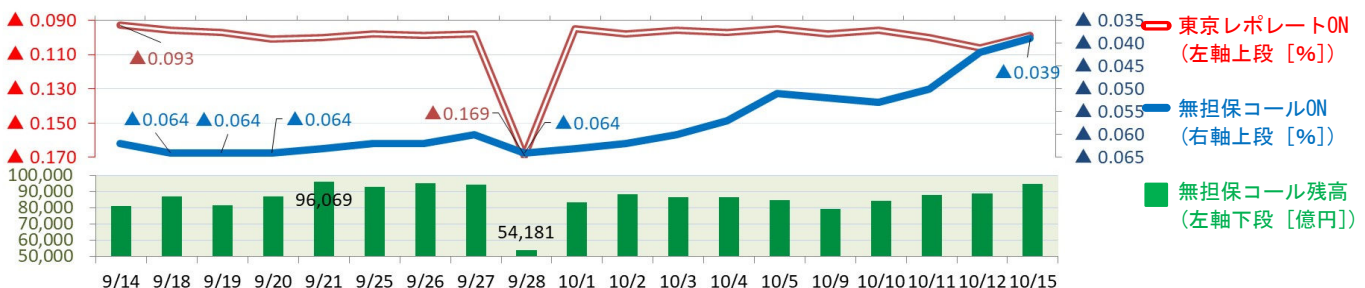
10月17日 1年	第864回
10月18日 3ヶ月	第865回
10月25日 3ヶ月	
11月1日 3ヶ月	
国債入札予定	
10月17日 5年	
10月24日 20年	
10月29日 2年	
11月6日 10年	

### 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	7 15 21 28	10月7日	3
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	4 15 21 28	10月4日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	7 18 30	10月7日	2
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
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。