

短期市場の推移

	10月15日	10月16日	10月17日	10月18日
加重平均金利	▲0.009	▲0.051	▲0.045	▲0.031
東京レポレート(ON)	▲0.076	▲0.094	▲0.083	▲0.069
無コール残	73,689	80,007	80,142	76,289
ON	51,009	58,112	58,687	52,684
その他	22,680	21,895	21,455	23,605
有コール残	19,816	19,771	19,973	20,912

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23日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (10月20日現在)	-	20:00 (米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標	-	(欧)10月の消費者信頼感	-
17:00頃	日本銀行が保有する国債の銘柄別残高	-	-	-

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	▲0.150	0.001	▲0.019	▲0.077
T/N	-	-	-	▲0.062
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.020	▲0.022	▲0.066
2W	-	-	▲0.020	▲0.070
3W	-	-	0.000	▲0.077
1M	-	-	▲0.010	▲0.084
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.147
6M	-	-	-	▲0.175
1Y	-	-	-	▲0.192

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▲0.020%の出合から始まった。前営業日よりも調達意欲は旺盛であり、その後は主に▲0.025%~▲0.015%の高めの水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前日対比+0.012%の▲0.019%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は旺盛で、本日と同様の地合いを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月21日	10月23日	10月23日	10月24日	10月24日	10月24日
券	▲300	▲500	▲500	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+4,800	▲2,900	▲2,900	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	+4,500	▲3,400	▲3,400	+1,000	+1,000	+1,000
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
国債買入	+1,600	+1,600	+1,600	+11,800	+11,800	+11,800
共通担保(全店)	▲1,600	+3,600	+3,600	-	-	-
CP等買入	▲200	-	-	▲100	▲100	▲100
社債等買入	-	-	-	-	-	+1,300
国債補完供給	+100	▲100	+100	-	-	-
当座預金増減	+7,900	+8,400	+8,400	+2,300	+2,300	+2,300
当座預金残高	4,087,100	4,095,500	4,095,500	4,097,800	4,097,800	4,097,800
準備預金残高	3,576,900	3,576,900	3,576,900	3,576,900	3,576,900	3,576,900
積み終了先	3,575,100	3,575,100	3,575,100	3,575,100	3,575,100	3,575,100
超過準備	3,574,100	3,574,100	3,574,100	3,574,100	3,574,100	3,574,100
非準備預金残高	510,200	510,200	510,200	510,200	510,200	510,200
準備預金進捗率	99.5%	99.5%	99.5%	99.5%	99.5%	99.5%
平均	22.6%	22.6%	22.6%	22.6%	22.6%	22.6%
乖離率	76.9%	76.9%	76.9%	76.9%	76.9%	76.9%

10月21日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(10/23~)						
~1年	500	2,271	501	0.020	0.023	87.6
1~3年	4,200	9,859	4,204	0.002	0.004	43.7
3~5年	3,400	5,923	3,402	▲0.004	▲0.001	63.9
5~10年	3,500	9,018	3,507	0.010	0.011	57.6
国債補完供給(10/21~10/23)						
		58	58	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
 10月18日時点 5,199,700

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,194,000
 10月23日以降の残り所要積数 15,300
 平均 600

国庫短期証券入札予定

10月25日	3ヶ月	第866回
11月1日	3ヶ月	
11月7日	6ヶ月	
11月8日	3ヶ月	
10月24日	20年	
10月29日	2年	
11月6日	10年	
11月8日	物価連動	

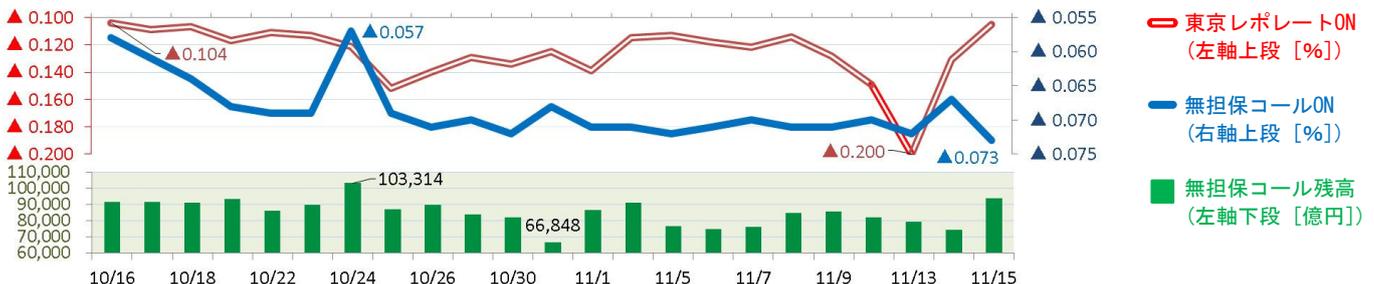
今月の国債買入オペ予定

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21日	0
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21日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	4 15 21 28	10月21日	1
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18日	1
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	10月15日	0

1年前の市場推移

○2018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。