

短期市場の推移

	10月16日	10月17日	10月18日	10月21日
加重平均金利	▲0.051	▲0.045	▲0.031	▲0.019
東京レポレート(ON)	▲0.094	▲0.083	▲0.069	▲0.077
無コール残	80,007	80,142	76,289	76,227
ON	58,112	58,687	52,684	52,242
その他	21,895	21,455	23,605	23,985
有コール残	19,771	19,973	20,912	19,457

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24日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:00 金融システムレポート(2019年10月号)	-	20:45 (欧)ECB政策金利発表	0.0%
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-	-	22:45 (米)10月製造業PMI	-

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	▲0.014	▲0.077
T/N	-	-	-	▲0.070
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	0.230	▲0.003	▲0.069
2W	▲0.020	▲0.012	▲0.019	▲0.073
3W	-	-	-	▲0.079
1M	-	-	-	▲0.087
2M	-	-	-	-
3M	▲0.030	0.060	0.030	▲0.143
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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.02%~▲0.01%の水準で取引された。信託や証券を中心に引き続き資金調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は前日対比+0.005%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.010

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23日	10月24日	10月24日	10月25日	10月25日	10月26日
券	▲500	▲1,200	▲1,200	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲6,000	▲1,800	▲1,800	▲8,000	▲8,000	▲8,000
過不足	▲6,500	▲3,000	▲3,000	▲9,000	▲9,000	▲9,000
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		+11,800				
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入				+1,300		
ETF買入				+600		
国債補完供給	+100					
当座預金増減		+5,300		▲200		▲9,000
当座預金残高		4,092,400		4,092,200		4,083,200
準備預金残高		3,571,600		3,570,400		3,570,200
積み終了先		3,570,400		3,570,200		3,570,200
超過準備		3,570,200		3,570,200		3,570,200
非準備預金残高		520,800		520,800		520,800
準備預金進捗率		99.6%		99.6%		99.6%
平均		25.8%		25.8%		25.8%
乖離率		73.8%		73.8%		73.8%

10月23日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(10/24~)	1,000	7,051	1,000	0.042	0.043	90.5
米ドル資金供給(10/25~10/31)	0	0	2,380	2,380		
国債補完供給(10/23~10/24)	36	36	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月21日時点 5,207,800	今積期の所要準備額 3,194,000
	10月24日以降の残り所要積数 13,900
	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	

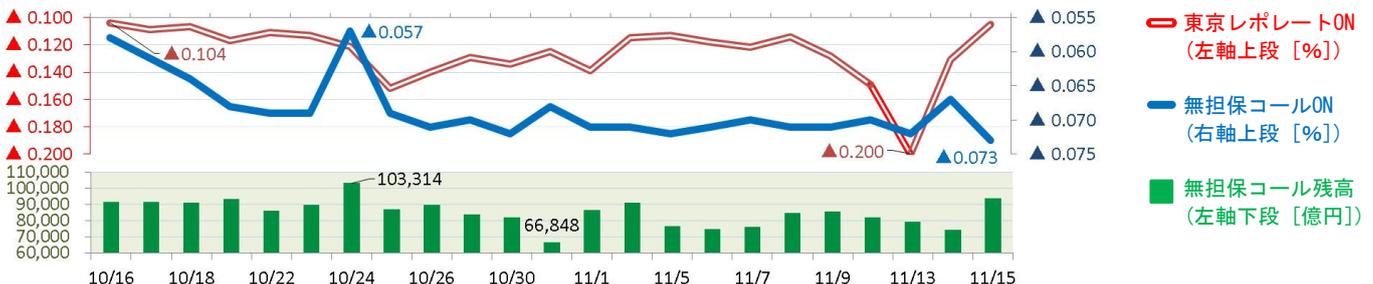
今月の国債買入オペ予定

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	7 15 21 28	10月21日	1
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	4 15 21 28	10月21日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	7 18 30	10月18日	1
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1回	10月4日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000		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。