

短期市場の推移

	10月18日	10月21日	10月23日	10月24日
加重平均金利	▲0.031	▲0.019	▲0.014	▲0.013
東京レポレート(ON)	▲0.069	▲0.077	▲0.077	▲0.075
無コール残	76,289	76,227	74,424	74,946
ON	52,684	52,242	50,854	50,816
その他	23,605	23,985	23,570	24,130
有コール残	20,912	19,457	19,268	19,093

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28日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 企業向けサービス価格指数(9月)	-	21:30 (米)9月シカゴ連銀全米活動指数	0.20
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.080	0.001	▲0.014	▲0.065
T/N	-	-	-	▲0.060
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.015	▲0.066
2W	-	-	▲0.013	▲0.067
3W	▲0.015	0.000	▲0.011	▲0.076
1M	-	-	-	▲0.083
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.000	▲0.134
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。3日積みということもあり、ビッドサイドの資金調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.015	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

週明けもビッドサイドの調達意欲は旺盛で、本日と同様に堅調な地合を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月25日	10月28日	10月28日	10月29日	10月29日	10月29日
券	▲300	+400		+0		+0
財政	▲4,100	+10,300		+1,000		+1,000
過不足	▲4,400	+10,700		+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
共通担保(全店)		▲2,200	▲3,900			
CP等買入	▲400					
社債等買入	▲200					
ETF買入		+600				
国債補完供給	▲200	+200				
当座預金増減	▲4,600	+12,600		+1,000		+1,000
当座預金残高	4,086,700	4,099,300		4,100,300		4,100,300
準備預金残高	3,560,500					
積み終了先	3,559,200					
超過準備	3,559,100					
非準備預金残高	526,200					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	38.7%					
乖離率	61.0%					

10月25日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(10/25~10/28)	199	199	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(10/28~11/11)	10	10	▲0.350	▲0.350		
	15,000	3,918	3,918			

マナタリーベース [億円]
10月24日時点 5,213,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,194,000
10月28日以降の残り所要積数 8,900
平均 500

国庫短期証券入札予定

11月1日	3ヶ月	第867回
11月7日	6ヶ月	
11月8日	3ヶ月	
11月15日	3ヶ月	
10月29日	2年	
11月6日	10年	
11月8日	物価運動	
11月12日	30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
物価運動債	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。