

短期市場の推移

	10月23日	10月24日	10月25日	10月28日
加重平均金利	▲0.014	▲0.013	▲0.014	▲0.016
東京レポレート(ON)	▲0.077	▲0.075	▲0.065	▲0.063
無コール残	74,424	74,946	77,374	75,521
ON	50,854	50,816	53,524	50,486
その他	23,570	24,130	23,850	25,035
有コール残	19,268	19,093	19,354	19,126

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30日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 製造業部門別投入・産出物価指数(9月)	-	FOMCの結果	-
-	-	21:15 (米)10月ADP全米雇用報告	13.2万人
-	-	21:30 (米)7-9月期GDP速報値[前期比年率]	1.5%

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	▲0.050	0.001	▲0.021	▲0.072
T/N	-	-	-	▲0.059
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.005	▲0.018	▲0.062
2W	-	-	-	▲0.065
3W	-	-	▲0.010	▲0.071
1M	-	-	-	▲0.078
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.173
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%の出合から始まり、その後は主に▲0.03%~▲0.015%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.005%の▲0.021%となった。

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

翌営業日のマーケット

本日対比で地合は弱含むと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月29日	10月30日	10月30日	10月31日	10月31日	10月31日
券	▲300	▲300	▲300	▲900	▲900	▲900
財政	▲4,600	+1,100	+1,100	▲1,600	▲1,600	▲1,600
過不足	▲4,900	+800	+800	▲2,500	▲2,500	▲2,500
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		+11,700				
CP等買入	▲100		▲100			+2,500
ETF買入		+100				
国債補完供給		▲100	+100			
当座預金増減		+6,700	+1,800	+0	+0	+0
当座預金残高		4,109,100	4,110,900	4,110,900	4,110,900	4,110,900
準備預金残高		3,578,200	主な需給要因			
積み終了先		3,576,800				
超過準備		3,576,700				
非準備預金残高		530,900				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		45.2%				
乖離率		54.7%				

10月29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(10/30~)	1,000	5,780	1,000	0.035	0.047	7.5
米ドル資金供給(10/31~11/7)	0	0	2,140	2,140		
国債補完供給(10/29~10/30)	84	84	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース	所要
10月28日時点 5,224,700	今積期の所要準備額 3,194,000
	10月30日以降の残り所要積数 5,700
	平均 300

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	
11月6日	10年	
11月8日	物価運動	
11月12日	30年	
11月14日	5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28日	0
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	4 15 21 28	10月28日	0
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28日	0
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。