

短期市場の推移

	10月28日	10月29日	10月30日	10月31日
加重平均金利	▲0.016	▲0.021	▲0.024	▲0.030
東京レポレート(ON)	▲0.063	▲0.072	▲0.073	▲0.064
無コール残	75,521	77,200	77,828	74,425
ON	50,486	51,675	53,053	53,760
その他	25,035	25,525	24,775	20,665
有コール残	19,126	19,553	19,831	19,814

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。

11月5日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (10月31日現在)	19:00	(欧)9月生産者物価指数 [前年比]
	-	22:30	(米)9月貿易収支
	-		-530億米ドル

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	▲0.060	0.001	▲0.024	▲0.064
T/N	-	-	-	▲0.059
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.020	▲0.023	▲0.061
2W	▲0.040	0.000	▲0.029	▲0.063
3W	-	-	0.000	▲0.072
1M	-	-	-	▲0.080
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.125
6M	-	-	-	▲0.170
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▲0.025%の割合から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.02%の水準で取引された。週末要因からビッドサイドの調達意欲が盛り返したため、同加重平均金利(速報)は前日対比+0.006%の▲0.024%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.035 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

4日積み要因が剥落するため、出合の水準は本日よりも低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月1日	11月5日	11月5日	11月6日	11月6日	11月6日
券	▲800	+500	+500	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲28,800	▲5,900	▲5,900	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	▲29,600	▲5,400	▲5,400	+2,000	+2,000	+2,000
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				+4,100		
共通担保(全店)		▲3,600		+1,700		
CP等買入		▲100				
当座預金増減	▲29,600	▲3,300	▲3,300	+2,000	+2,000	+2,000
当座預金残高	4,076,500	4,073,200	4,073,200	4,075,200	4,075,200	4,075,200
準備預金残高	3,533,800					
積み終了先	3,533,300					
超過準備	3,533,300					
非準備預先残高	542,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	64.5%					
乖離率	35.4%					

11月1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(11/5~)						
5~10年	3,500	9,211	3,504	▲0.047	▲0.044	25.9
物価連動	300	1,320	301	0.350	0.288	87.5
国債補充供給(11/1~11/5)			0	0		
共通担保(全店)(11/5~11/11)			15,000	1,723	1,723	

マナタリーベース	所要
10月31日時点 5,230,300	今積期の所要準備額 3,193,600
	11月5日以降の残り所要積数 2,300
	平均 200

国庫短期証券入札予定

11月7日	6ヶ月	第868回
11月8日	3ヶ月	第869回
11月15日	3ヶ月	
11月19日	1年	
11月6日	10年	
11月8日	物価連動	
11月12日	30年	
11月14日	5年	

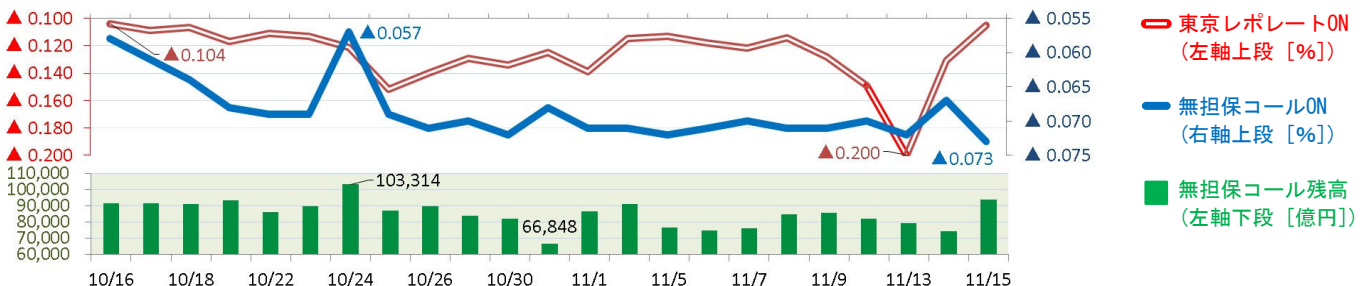
今月の国債買入オペ予定

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	2
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	5 11 19 25	10月28日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	1 11 19 27	11月1日	3
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300	5 15 25	10月30日	3
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	11月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	10月15日	-

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。