

短期市場の推移

	9月26日	9月27日	9月28日	10月1日
加重平均金利	▲0.062	▲0.060	▲0.064	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.099	▲0.098	▲0.169	▲0.095
無コール残	95,124	94,437	54,181	83,422
ON	57,254	56,762	31,241	52,602
その他	37,870	37,675	22,940	30,820
有コール残	23,088	28,592	10,272	27,967

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3日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 日銀当座預金増減要因(10月見込み)	-	20:00 (米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
-	-	21:15 (米)9月ADP全米雇用報告	18.5万人
-	-	23:00 (米)9月ISM非製造業景況指数	58.0

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	▲0.086	0.001	▲0.062	▲0.098
T/N	-	-	0.000	▲0.104
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.010	▲0.023	▲0.108
2W	▲0.030	▲0.020	▲0.022	▲0.110
3W	-	-	-	▲0.116
1M	▲0.028	0.001	▲0.018	▲0.122
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.157

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、▲0.075%の合出から始まり、その後は主に▲0.085%~▲0.04%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.062%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.084	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

ビッドサイドは比較的多いが、大きく取りあがる展開にはならず、レートは小幅上昇と予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月2日	10月3日	10月4日
券	+100	+300	▲1,000
財政	▲10,800	▲60,500	+2,000
過不足	▲10,700	▲60,200	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+1,000
CP等買入	▲100	▲100	
国債補完供給	+3,700	+1,700	
当座預金増減	▲8,800	▲57,600	+1,000
当座預金残高	3,922,700	3,865,100	3,866,100
準備預金残高	3,430,400	主な需給要因	
積み終了先	3,430,200	法人税・消費税・保険掛け	
超過準備	3,429,900	国債発行(10年)	
非準備預金残高	492,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	56.7%		
乖離率	43.2%		

10月2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(10/3~)	1,000	6,132	1,001	0.004	0.005	46.7
米ドル資金供給(10/4~10/12)	0	0	2,680	2,680		
国債補完供給(10/2~10/3)	99,083	1,694	1,694	▲0.600	▲0.600	
	17,047	0	0			

マナタリーベース	所要
10月1日時点	今積期の所要準備額
5,025,600	2,992,200
	10月3日以降の残り所要積数
	1,900
	平均
	100

国庫短期証券入札予定

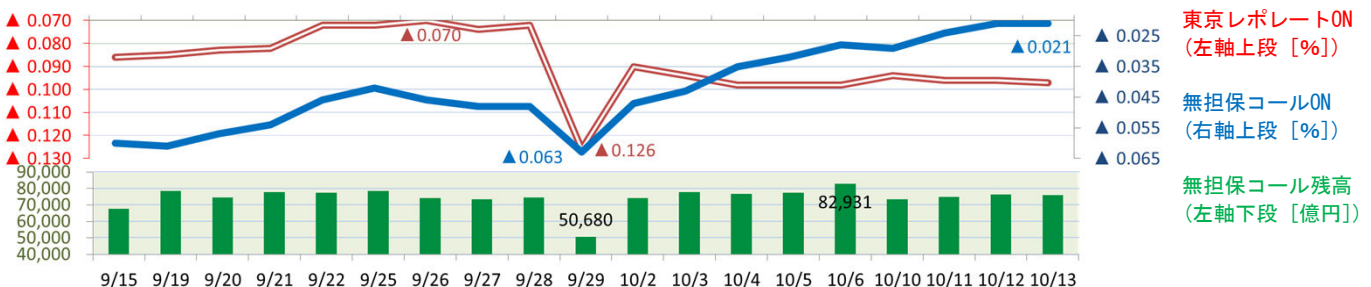
10月5日	3ヶ月	第787回
10月9日	6ヶ月	第788回
10月12日	3ヶ月	
10月18日	1年	
10月11日	30年	
10月16日	5年	
10月18日	20年	
10月25日	2年	

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	9月14日	2
1年超3年以下	2,000~4,000 程度	3,000			
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	3 12 17 26 30	9月27日	5
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	3 10 17 24 26	9月25日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	500	5 12 19 24 30	9月27日	5
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	9月25日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	8月17日	1

1年前の市場推移

○2017年9月積み期 [9月15日~10月13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。