

短期市場の推移

	10月3日	10月4日	10月5日	10月9日
加重平均金利	▲0.060	▲0.057	▲0.051	▲0.052
東京レポレート(ON)	▲0.096	▲0.097	▲0.095	▲0.098
無コール残	86,520	86,820	84,999	79,326
ON	54,025	53,425	51,314	47,721
その他	32,495	33,395	33,685	31,605
有コール残	27,559	26,053	27,827	26,270

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11日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	9月国内企業物価指数[前年比]	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
10:30	【挨拶】櫻井審議委員(秋田)	21:30	(米)9月消費者物価コア指数[前年比]
			G20財務相・中央銀行総裁会議(12日まで)

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	▲0.053	▲0.096
T/N	-	-	0.000	▲0.108
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.015	▲0.115
2W	▲0.010	▲0.005	▲0.007	▲0.120
3W	-	-	▲0.020	▲0.123
1M	-	-	-	▲0.130
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.156

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、▲0.07%の出合から始まった。その後は主に▲0.08%~▲0.02%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▲0.053%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

地銀業態を中心に資金調達需要は継続と思われるため、本日と同様の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10日	10月11日	10月11日	10月12日	10月12日
券		+800		▲300	▲1,000
財政		▲1,700		▲1,400	▲4,000
過不足		▲900		▲1,700	▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+5,100	
CP等買入	▲200	+2,000	▲200		
ETF買入				+300	
国債補完供給	+1,300	▲1,900	+1,900		
当座預金増減		+300		+5,400	▲5,000
当座預金残高		3,872,100		3,877,500	3,872,500
準備預金残高		3,404,000		3,403,900	
積み終了先		3,403,900			
超過準備		3,403,900			
非準備先残高		468,100			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		83.3%			
乖離率		16.6%			

[億円]

10月10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(10/11~)						
~1年	500	1,893	500	0.003	0.004	77.8
5~10年	4,500	10,269	4,510	▲0.005	▲0.004	26.1
米ドル資金供給(10/12~10/18)			0	0	2.690	2.690
国債補完供給(10/10~10/11)			238,141	1,831	1,831	▲0.600 ▲0.600

マナタリーベース [億円]
10月9日時点 4,965,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,003,300
10月11日以降の残り所要積数 800
平均 200

国庫短期証券入札予定

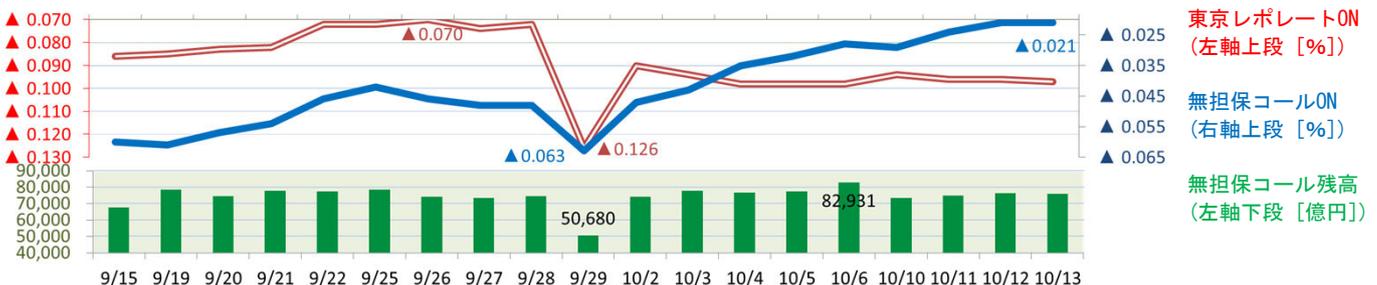
10月12日	3ヶ月
10月18日	1年
10月19日	3ヶ月
10月26日	3ヶ月
10月11日	30年
10月16日	5年
10月18日	20年
10月25日	2年

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	10月10日	1
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	10月3日 4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	3	10 17 24 26	10月10日 3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	5	12 19 24 30	10月5日 4
25年超	500~1,500 程度	500			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	10月5日	1
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。