

平成30年10月11日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	10月4日	10月5日	10月9日	10月10日
加重平均金利	▲0.057	▲0.051	▲0.052	▲0.053
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.095	▲0.098	▲0.096
無コール残	86,820	84,999	79,326	84,413
ON	53,425	51,314	47,721	53,408
その他	33,395	33,685	31,605	31,005
有コール残	26,053	27,827	26,270	24,731

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。

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	▲0.050	▲0.100
T/N	-	-	0.000	▲0.118
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.019	▲0.120
2W	-	-	-	▲0.123
3W	-	-	0.000	▲0.128
1M	▲0.015	0.000	▲0.011	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.003	▲0.149
6M	-	-	-	▲0.148
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

10月12日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
10:00	日銀営業毎旬報告 (10月10日現在)	-	23:00	(米)10月ミシガン大学 消費者信頼感指数速報	100.8
	櫻井審議委員記者会見 要旨(10月11日分)			-	
	-			-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.065%の合出から始まった。その後は主に▲0.075%~▲0.02%の水準で取引された。地銀業態を中心にビッドが厚く、堅調な地合となり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.05%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.065		▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるため、本日同様堅調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 10月11日	日銀予想 10月12日	当社需給予想 10月15日
券	▲200	+0	+1,000
財政	▲1,100	▲2,900	+81,000
過不足	▲1,300	▲2,900	+82,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+1,000
国債買入	+5,100		
共通担保(全店)			▲1,900
CP等買入	▲200	▲300	
ETF買入	+300		
国債補完供給	+1,900	+1,100	
当座預金増減	+4,700	▲1,100	+80,100
当座預金残高	3,876,800	3,875,700	3,955,800
準備預金残高	3,399,800	主な需給要因	
積み終了先	3,399,600		
超過準備	3,399,600	源泉税揚げ 国債発行(30年)	年金定時払い 国庫短期証券 発行・償還(3M) 国債償還(2年)
非準備預金残高	477,000		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	86.7%		
乖離率	13.2%		

10月11日のオペ結果 [%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(10/12~)	1,000	9,540	1,000	0.016	0.016	
CP等買入(10/16~)	2,000	4,731	1,975	▲0.004	▲0.001	88.5
国債補完供給(10/11~10/12)	148,391	1,118	1,118	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
10月10日時点 4,965,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,003,300
10月12日以降の残り所要	
積数	600
平均	100

国庫短期証券入札予定

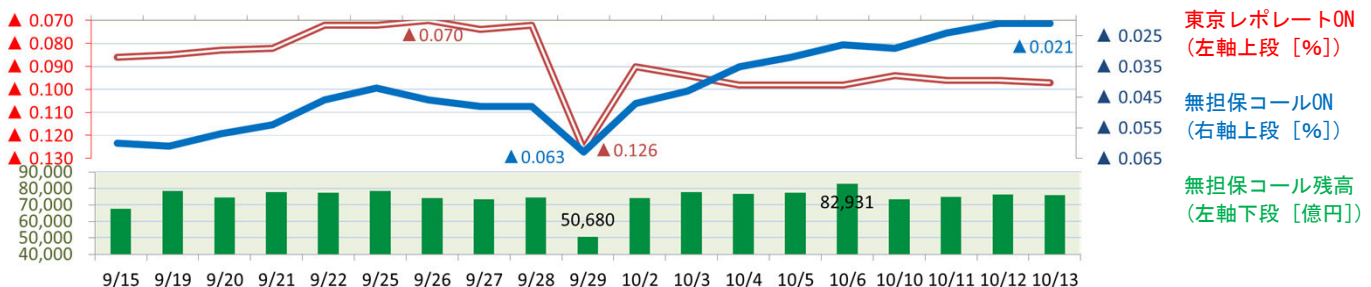
10月12日 3ヶ月 第789回
10月18日 1年 第790回
10月19日 3ヶ月
10月26日 3ヶ月
国債入札予定
10月16日 5年
10月18日 20年
10月25日 2年
11月1日 10年

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。