

短期市場の推移

	10月10日	10月11日	10月12日	10月15日
加重平均金利	▲0.053	▲0.050	▲0.042	▲0.039
東京レポレート(ON)	▲0.096	▲0.100	▲0.106	▲0.099
無コール残	84,413	88,068	89,025	94,871
ON	53,408	57,413	58,260	64,736
その他	31,005	30,655	30,765	30,135
有コール残	24,731	21,090	21,846	22,796

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17日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
		21:30	(米)9月住宅着工件数
			FOMC議事録(9月25,26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	▲0.059	▲0.104
T/N	-	-	0.000	▲0.138
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	0.000	▲0.025	▲0.140
2W	▲0.030	▲0.010	▲0.025	▲0.139
3W	-	-	-	▲0.141
1M	-	-	0.001	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.149
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

積み初日となる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%~▲0.03%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▲0.02%の▲0.059%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

本日と同様に地銀業態を中心にビッドサイドは厚いが、大きく取りあがる展開にはならないと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月16日	10月17日	10月17日	10月18日	10月18日	10月19日
券		+100		▲100		▲1,000
財政		▲100		▲20,300		+3,000
過不足		+0		▲20,400		+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
国庫短期証券買入				+1,000		
CP等買入	▲100	+2,000	▲100			
社債等買入	▲100					
ETF買入				+100		
国債補完供給	+1,900	▲1,900	+1,900			
当座預金増減		+1,800		▲17,500		+2,000
当座預金残高		3,968,100		3,950,600		3,952,600
準備預金残高		3,470,900				
積み終了先		2,165,700				
超過準備		953,300				
非準預先残高		497,200				
準備預金進捗率		81.1%				
平均		3.2%				
乖離率		77.9%				

10月16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(10/17~)	1,000	7,566	1,001	0.015	0.016	75.8
米ドル資金供給(10/18~10/25)		0	0	2.690	2.690	
国債補完供給(10/16~10/17)	20,000	1,798	1,798	▲0.500	▲0.500	

マナタリーベース	所要
10月15日時点 5,059,200	今積期の所要準備額 3,103,600
	10月17日以降の残り所要積数 586,000
	平均 19,500

国庫短期証券入札予定

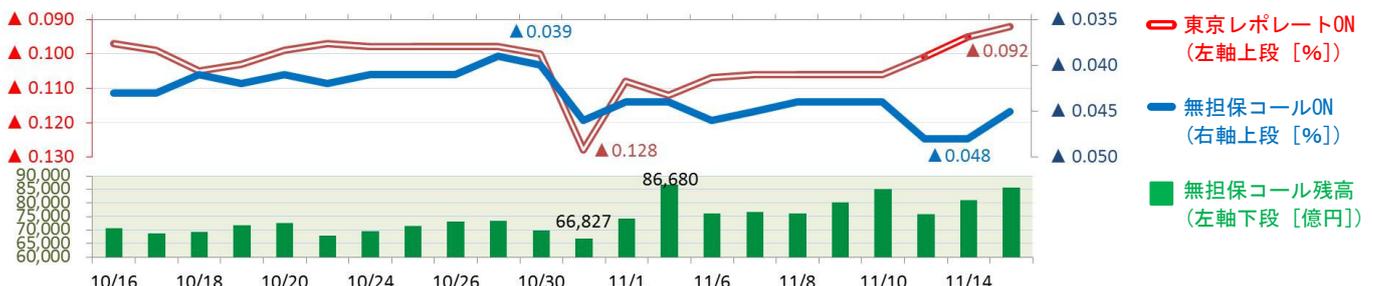
10月18日	1年	第790回
10月19日	3ヶ月	第791回
10月26日	3ヶ月	
11月2日	3ヶ月	
10月18日	20年	
10月25日	2年	
11月1日	10年	
11月6日	物価連動	

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12日	3
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			
25年超	500~1,500 程度	500	5/12 19 24 30	10月12日	3
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。