

短期市場の推移

	10月15日	10月16日	10月17日	10月18日
加重平均金利	▲0.039	▲0.058	▲0.061	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.099	▲0.104	▲0.109	▲0.107
無コール残	94,871	91,572	91,668	91,287
ON	64,736	60,237	59,083	58,072
その他	30,135	31,335	32,585	33,215
有コール残	22,796	16,363	18,643	16,394

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22日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	主要銀行貸出動向アンケート調査(10月)	-	-	-
14:00	金融システムレポート(2018年10月号)	-	-	-

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	▲0.068	▲0.117
T/N	-	-	0.000	▲0.134
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.230	▲0.015	▲0.140
2W	-	-	0.000	▲0.143
3W	-	-	-	▲0.143
1M	-	-	-	▲0.144
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.150
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、▲0.080%の出合から始まり、その後は主に▲0.086%~▲0.040%のレンジで取引された。朝一からギブン地合いとなり昨日より更に弱含む展開となったことで、▲0.08%台の出合は相応量みられた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

週明けも引き続き軟調な地合いが継続するものと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月19日	10月22日	10月22日	10月23日	10月23日	10月23日
券	▲500	+300	▲500	+300	▲500	+300
財政	▲4,800	▲7,900	▲4,800	▲7,900	▲4,800	▲7,900
過不足	▲5,300	▲7,600	▲5,300	▲7,600	▲5,300	▲7,600
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				+2,900		
共通担保(全店)		▲1,400		+1,500		
CP等買入	▲200					
社債等買入	▲300					
ETF買入		+100		+500		
被災地金融機関支援	▲100	+100				
国債補充供給	+1,700	▲1,900	+1,900			
当座預金増減	▲5,900	▲2,200	▲5,900	+2,000	▲5,900	+2,000
当座預金残高	3,953,300	3,951,100	3,953,300	3,953,100	3,953,300	3,953,100
準備預金残高	3,443,800		3,443,800		3,443,800	
積み終了先	3,440,700		3,440,700		3,440,700	
超過準備	3,429,400		3,429,400		3,429,400	
非準備預金残高	509,500		509,500		509,500	
準備預金進捗率	99.4%		99.4%		99.4%	
平均	19.4%		19.4%		19.4%	
乖離率	80.0%		80.0%		80.0%	

10月19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(10/22~)						
10~25年	1,800	6,339	1,813	▲0.003	▲0.003	99.7
25年~	500	1,783	506	▲0.003	▲0.003	56.8
物価連動	250	1,237	250	▲0.050	▲0.089	20.0
国債補充供給(10/19~10/22)						
共通担保(全店)	30,000	1,862	1,862	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(10/22~11/5)	8,000	1,502	1,502			

マナタリーベース	所要
10月18日時点 5,053,400	今積期の所要準備額 3,103,600
	10月22日以降の残り所要積数 18,800
	平均 800

国庫短期証券入札予定

10月26日	3ヶ月	第792回
11月2日	3ヶ月	
11月8日	6ヶ月	
11月9日	3ヶ月	
10月25日	2年	
11月1日	10年	
11月6日	物価連動	
11月13日	30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17日 2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	3/10/17	24/26	10月17日 2
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19日 2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	10月19日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10月17日	0

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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会