

短期市場の推移

	10月22日	10月23日	10月24日	10月25日
加重平均金利	▲0.069	▲0.069	▲0.057	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.111	▲0.113	▲0.121	▲0.152
無コール残	86,436	90,039	103,314	87,272
ON	52,211	56,654	66,479	54,057
その他	34,225	33,385	36,835	33,215
有コール残	16,141	17,981	14,100	14,411

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29日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 製造業部門別投入・産出物価指数(9月)	-	21:30 (米)9月個人所得	0.4%
-	-	21:30 (米)9月個人消費支出	0.4%
-	-	21:30 (米)9月個人消費支出価格コア指数[前年比]	2.0%

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	▲0.071	▲0.140
T/N	-	-	0.000	▲0.155
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.012	▲0.033	▲0.157
2W	-	-	-	▲0.151
3W	-	-	-	▲0.149
1M	-	-	-	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.151
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.159

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。週末であったものの、資金を取り急ぐ動きは見られず、軟調な地合いで推移した。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.071%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.035

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26日	10月29日	10月29日	10月30日	10月30日	10月31日
券	▲800	+200	▲2,600	▲2,000	▲2,000	▲1,000
財政	+1,300	▲2,800	▲2,600	▲2,000	▲2,000	▲1,000
過不足	+500	▲2,600	▲2,600	▲2,000	▲2,000	▲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
国債買入				+11,100		
共通担保(全店)			▲1,800	+2,100		
CP等買入	▲200		▲100			
社債等買入			▲100			
ETF買入		+1,100		+600		
国債補完供給	+700	▲1,300	+1,300			
当座預金増減	+800	+10,500	+10,500	▲2,000		
当座預金残高	3,954,700	3,965,200	3,965,200	3,963,200		
準備預金残高	3,453,700					
積み終了先	3,452,900					
超過準備	3,452,900					
非準備預金残高	501,000					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	41.9%					
乖離率	57.8%					

10月26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(10/29~)						
1~3年	3,000	7,757	3,006	0.000	0.002	23.0
3~5年	3,500	6,237	3,503	0.000	0.002	3.9
5~10年	4,500	11,686	4,502	0.006	0.007	50.0
CP等買入(10/31~)	2,000	5,606	1,960	▲0.002	0.002	93.5
国債補完供給(10/26~10/29)						
共通担保(全店)(10/29~11/12)	8,000	2,142	2,142			

マナタリーベース	所要
10月25日時点 5,051,400	今積期の所要準備額 3,103,600
	10月29日以降の残り所要積数 7,700
	平均 400

国庫短期証券入札予定

11月2日	3ヶ月	第793回
11月8日	6ヶ月	
11月9日	3ヶ月	
11月16日	3ヶ月	
11月1日	10年	
11月6日	物価運動	
11月13日	30年	
11月15日	5年	

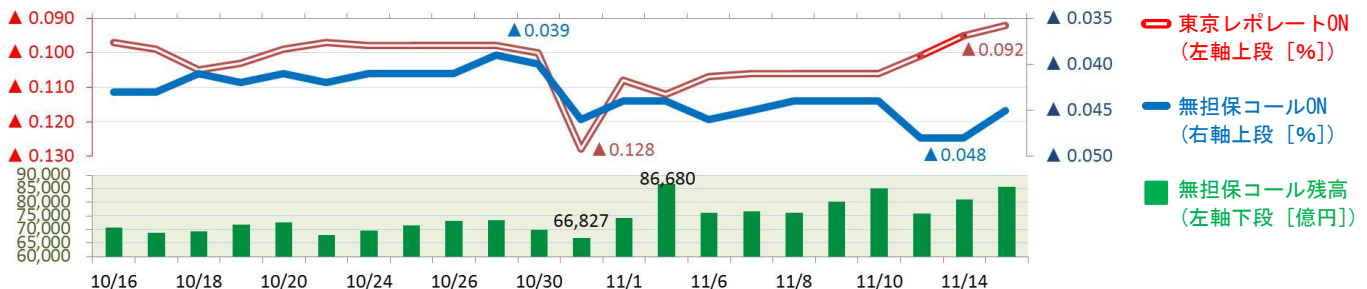
今月の国債買入オペ予定

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24日	0
1年超3年以下	2,000~4,000 程度	3,000	3 12 17 26 30	10月26日	1
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	3 10 17 24 26	10月26日	0
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	5 12 19 24 30	10月24日	1
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	月2回程度	10月19日	0
25年超	500~1,500 程度	500	月2回程度	10月17日	0
物価運動債	250 程度	250	1回		
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

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。