

短期市場の推移

[億円] [%]

	10月23日	10月24日	10月25日	10月26日
加重平均金利	▲0.069	▲0.057	▲0.069	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.113	▲0.121	▲0.152	▲0.140
無コール残	90,039	103,314	87,272	89,676
ON	56,654	66,479	54,057	55,911
その他	33,385	36,835	33,215	33,765
有コール残	17,981	14,100	14,411	14,131

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	▲0.086	0.001	▲0.070	▲0.129
T/N	-	-	0.000	▲0.148
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.028	▲0.033	▲0.152
2W	▲0.028	▲0.005	▲0.013	▲0.151
3W	-	-	▲0.040	▲0.149
1M	-	-	-	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
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

10月30日の予定(時刻は日本時間)

日本			予想	海外		予想
8:30	9月有効求人倍率	1.63倍		19:00	(欧)7-9月期GDP速報値[前年比]	1.8%
8:30	9月失業率	+2.4%		22:00	(独)10月消費者物価指数[前年比]	2.4%
	-	-		23:00	(米)10月消費者信頼感指数	136.2

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、▲0.080%の出合から始まり、その後は主に▲0.086%～▲0.04%台のレンジで取引された。先週に引続きビッドサイドが薄く、▲0.08%台のオファーも終日残る展開となった。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.070%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085		▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.085 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

引続きビッドサイドが薄く、軟調な地合が継続するものと予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月29日	10月30日	10月31日
券	+100	▲400	▲200
財政	▲1,500	▲2,900	+800
過不足	▲1,400	▲3,300	+600
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+11,100	▲11,100	▲11,100
共通担保(全店)	▲1,800	+2,100	+2,000
CP等買入	▲100	▲300	-
社債等買入	▲100	-	-
ETF買入	+600	+200	-
国債補完供給	+1,300	+300	-
当座預金増減	+11,400	▲3,100	+2,600
当座預金残高	3,966,100	3,963,000	3,965,600
準備預金残高	3,460,900	主な需給要因	
積み終了先	3,460,200	-	-
超過準備	3,460,200	-	-
非準備預金残高	505,200	-	-
準備預金進捗率	99.8%	-	-
平均	45.2%	-	-
乖離率	54.6%	-	-

10月29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
国債補完供給(10/29~10/30)	10,000	292	292	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
10月26日時点 5,053,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,103,600
10月30日以降の残り所要
積数 6,900
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	
国債入札予定		
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	

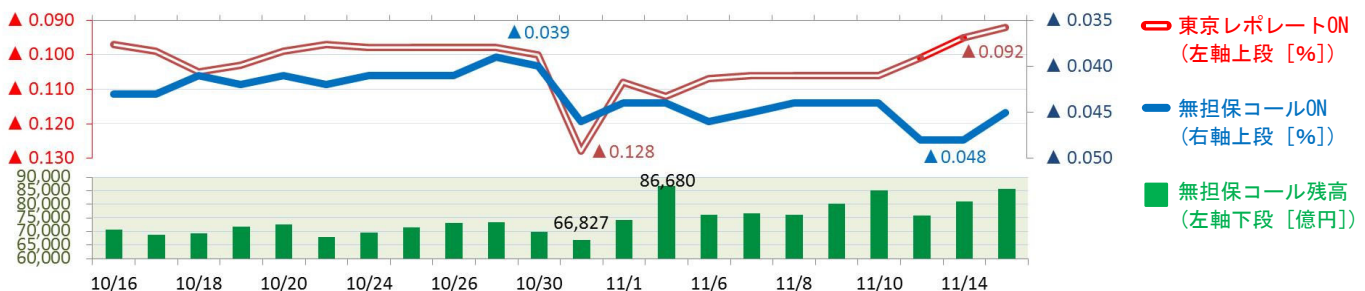
今月の国債買入オペ予定

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			
25年超	500~1,500 程度	500			
物価運動債	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。