

短期市場の推移

	10月25日	10月26日	10月29日	10月30日
加重平均金利	▲0.069	▲0.071	▲0.070	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.152	▲0.140	▲0.129	▲0.134
無コール残	87,272	89,676	84,109	81,957
ON	54,057	55,911	50,344	49,212
その他	33,215	33,765	33,765	32,745
有コール残	14,411	14,131	14,186	14,219

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。

11月1日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:00	経済・物価情勢の展望(10月、全文)	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
-	【記者会見】黒田総裁(10月31日)	21:30	(米)労働生産性速報値(7-9月) 1.8%
-	-	23:00	(米)10月ISM製造業景況指数 59.5

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	▲0.125
T/N	-	-	▲0.010	▲0.136
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.137
2W	▲0.047	▲0.030	▲0.037	▲0.137
3W	-	-	-	▲0.139
1M	▲0.025	0.010	▲0.010	▲0.142
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.030	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.150
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

無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まったものの、月末日にあたることから資金調達を控える先が多く、▲0.086%のオファーが出し残る展開となった。前営業日より▲0.08%台のビッドが薄く、その水準の取引量が減少したことから、同加重平均金利は前営業日対比+0.004%の▲0.068%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086		▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.050

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月31日	11月1日	11月1日	11月2日	11月2日	11月2日
券		+0	▲800	▲1,000		
財政		▲3,400	▲29,000	▲28,000		
過不足		▲3,400	▲29,800	▲29,000		
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				
国債買入		+8,900				
CP等買入	▲1,700	+2,000				
社債等買入	▲100					
ETF買入		+900				
国債補完供給	+400	▲200	+200			
当座預金増減		+7,800	▲29,600	▲29,000		
当座預金残高	3,970,300	3,940,700	3,940,700	3,911,700		
準備預金残高	3,464,500	主な需給要因				
積み終了先	3,463,700					
超過準備	3,463,700					
非準備先残高	505,800	国債発行(2年)	法人税・消費税・保険揚げ			
準備預金進捗率	99.8%	国債発行(10年)				
平均	51.6%					
乖離率	48.2%					

10月31日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(10/31~11/1)	53,029	146	146	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月30日時点 5,061,100	今積期の所要準備額 3,102,700
	11月1日以降の残り所要積数 5,500
	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	

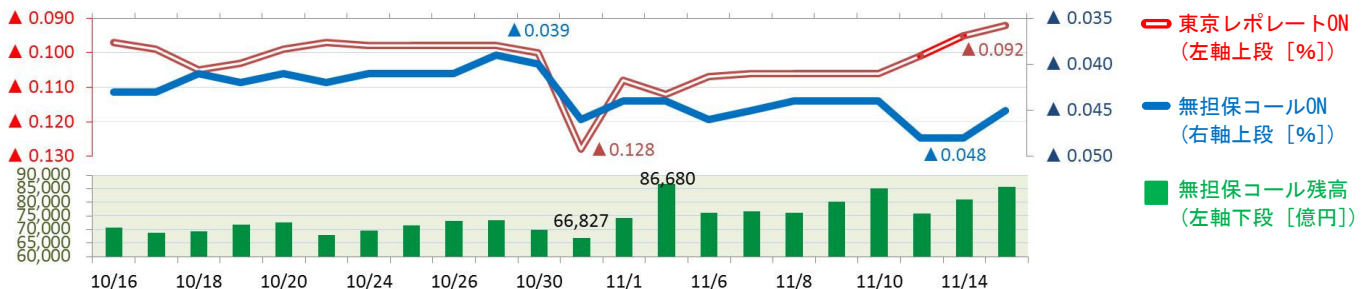
来月の国債買入オペ予定

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	2
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,000			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	3,500	2 9 19 28	10月30日	4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2 12 16 26 30	10月26日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	5 9 16 26 30	10月30日	5
物価運動債	250 程度	250	月2回程度	10月19日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10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。