

### 短期市場の推移

	10月1日	10月2日	10月5日	10月6日
加重平均金利	▲0.031	▲0.022	▲0.019	▲0.014
東京レポレート(ON)	▲0.087	▲0.079	▲0.070	▲0.073
無コール残	94,129	102,935	87,549	86,106
ON	62,586	68,522	51,786	48,093
その他	31,543	34,413	35,763	38,013
有コール残	20,412	22,467	22,359	22,497

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8日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	8月国際収支 (経常収支) 18,232億円	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
10:00頃	【挨拶】黒田総裁 (支店長会議)		(米)アトランタ連銀総裁講演
14:00	地域経済報告(10月)		

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	▲0.060	0.001	▲0.010	▲0.071
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.006	▲0.076
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.005	▲0.079
2W	-	-	▲0.015	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	▲0.030	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.122
6M	-	-	-	▲0.142
1Y	-	-	-	▲0.163

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▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.005%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.010%と、2020年4月14日以来約6か月ぶりの高水準となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.008	▲0.010 ~ ▲0.008	▲0.010 ~ ▲0.005

### 翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は旺盛で、堅調な地合を想定。

### 資金需給

	日銀速報 10月7日	日銀予想 10月8日	当社需給予想 10月9日
券	+500	+0	▲1,000
財政	▲8,300	+1,900	▲25,000
過不足	▲7,800	+1,900	▲26,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+10,000		
国債買入		+4,000	
CP等買入		▲200	
社債等買入		+3,000	
ETF買入	+1,100	+400	
国債補完供給	▲500	+500	
米ドル資金供給用担保国債供給			+2,200
当座預金増減	+2,800	+9,600	▲23,800
当座預金残高	4,774,600	4,784,200	4,760,400
準備預金残高	4,207,300	主な需給要因	
積み終了先	4,207,300		
超過準備	4,207,300		
非準預先残高	567,300	国債発行(5年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	73.3%		
乖離率	26.6%		

### 10月7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	接分
国債買入(10/8~)						
3~5年	3,500	12,261	3,504	▲0.002	▲0.001	33.3
変動利付	500	1,160	501	▲0.350	▲0.392	67.5
国債補完供給(10/7~10/8)						
		443	443	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]  
10月6日時点 5,956,600

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,421,200  
10月8日以降の残り所要積数 100  
平均 0

### 国庫短期証券入札予定

10月8日	16ヶ月	第942回
10月9日	3ヶ月	第943回
10月16日	3ヶ月	
10月19日	1年	
国債入札予定		
10月8日	5年	
10月20日	20年	
10月27日	2年	
11月4日	10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	500~1,500	1,000	月3回程度	10月2日	2
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 26 30	10月5日	5
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	10月7日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 30	10月5日	4
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 26	10月2日	1
25年超	0~500	300	9 26	9月28日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	9月28日	2
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	-

### 1年前の市場推移

○2019年9月積み期 [9月13日~10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。