

### 短期市場の推移

	10月13日	10月14日	10月15日	10月16日
加重平均金利	▲0.020	▲0.020	▲0.014	▲0.033
東京レポレート(ON)	▲0.069	▲0.078	▲0.081	▲0.083
無コール残	81,831	88,045	84,067	105,812
ON	46,313	52,597	50,574	72,189
その他	35,518	35,448	33,493	33,623
有コール残	19,828	19,266	20,601	20,932

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20日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
13:30	9月の首都圏マンション販売		21:30	(米)9月住宅着工件数 145.0万戸
14:00	9月のコンビニ売上高			NY連銀総裁の講演
	市場調節に関する意見交換会(オンライン開催)			シカゴ連銀総裁の講演

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	▲0.075	0.001	▲0.031	▲0.074
T/N	-	-	▲0.001	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.020	▲0.025	▲0.082
2W	▲0.020	▲0.015	▲0.016	▲0.085
3W	-	-	0.020	▲0.089
1M	▲0.030	▲0.010	▲0.018	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.112
6M	-	-	-	▲0.138
1Y	-	-	-	▲0.160

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▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.015%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+0.002%の▲0.031%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.040 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達スタンスに変化はなく、堅調な地合を予想。

### 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月19日	10月20日	10月21日
券	▲300	▲300	+0
財政	▲16,900	▲20,400	▲10,000
過不足	▲17,200	▲20,700	▲10,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲2,300	+2,800	
CP等買入	▲300	▲200	
国債補完供給	+100	▲200	+200
当座預金増減	▲17,100	▲20,700	▲10,000
当座預金残高	4,852,000	4,831,300	4,821,300
準備預金残高	4,237,600	主な需給要因	
積み終了先	4,233,700		
超過準備	4,231,000		
非準備先残高	614,400	国庫短期証券	
準備預金進捗率	99.7%	発行・償還(1Y)	
平均	12.9%	国債発行(20年)	
乖離率	86.8%		

### 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
国債補完供給(10/19~10/20)	161	161	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]  
10月16日時点 6,052,800

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,537,500  
10月20日以降の残り所要積数 10,500  
平均 400

### 国庫短期証券入札予定

10月22日	16ヶ月	第946回
10月23日	3ヶ月	第947回
10月30日	3ヶ月	
11月6日	3ヶ月	
10月20日	20年	
10月27日	2年	
11月4日	10年	
11月6日	物価連動	

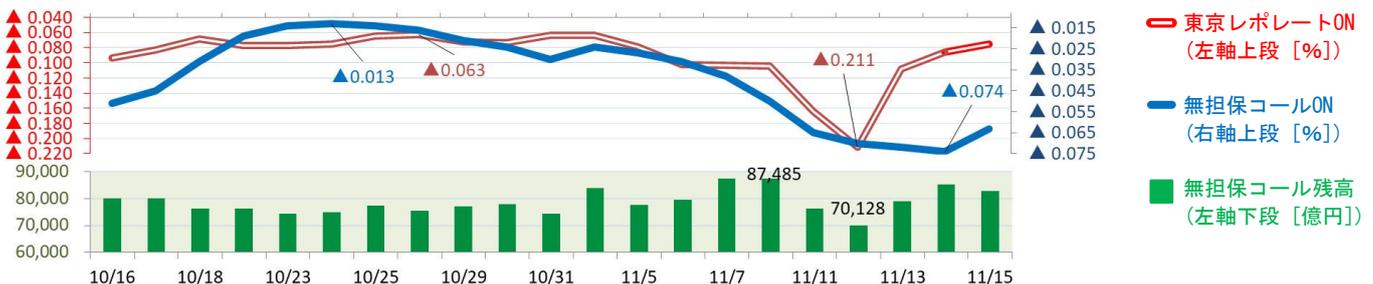
### 今月の国債買入オペ予定

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9日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 26 30	10月14日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	10月14日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 30	10月14日	2
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	10月9日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	10月14日	1
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	0

### 1年前の市場推移

○2019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。