

### 短期市場の推移

	10月26日	10月27日	10月28日	10月29日
加重平均金利	▲0.016	▲0.019	▲0.024	▲0.026
東京レポレート(ON)	▲0.078	▲0.078	▲0.084	▲0.091
無コール残	110,951	98,993	107,088	108,529
ON	60,038	55,980	62,575	62,516
その他	50,913	43,013	44,513	46,013
有コール残	19,544	21,282	18,613	19,307

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2日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.150	0.001	▲0.029	▲0.093
T/N	▲0.030	▲0.001	▲0.018	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.015	▲0.025	▲0.090
2W	▲0.030	0.010	▲0.017	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.092
1M	▲0.040	▲0.025	▲0.034	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.112
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.158

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▲0.030%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)前営業日対比▲0.003%の▲0.029%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.030	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.035 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばいを予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月30日	11月2日	11月2日	11月4日	11月4日	11月4日
券	▲500	▲300	▲300	+0	▲10,000	▲10,000
財政	+1,200	▲33,400	▲33,700	▲10,000	▲10,000	▲10,000
過不足	+700	▲33,700	▲33,700	▲10,000	▲10,000	▲10,000
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				+13,100		
共通担保(全店)			▲2,800	+1,600		
CP等買入	▲4,700		▲300			
社債等買入	▲100					
ETF買入		+700		+700		
国債補完供給	+200					
当座預金増減	▲3,200	▲21,400	▲21,400	▲10,000		
当座預金残高	4,893,200	4,871,800	4,871,800	4,861,800		
準備預金残高	4,273,600	主な需給要因				
積み終了先	4,273,600					
超過準備	4,273,300	国債発行・償還(2年)				
非率預先残高	619,600	国債発行・償還(3M)				
準備預金進捗率	99.9%					
平均	54.8%					
乖離率	45.1%					

### 10月30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(11/2~)						
~1年	1,000	2,122	1,004	0.007	0.017	77.2
1~3年	4,200	11,551	4,204	0.005	0.006	49.1
3~5年	3,500	11,323	3,509	0.007	0.008	37.3
5~10年	4,200	11,206	4,210	0.007	0.007	97.4
国債補完供給(10/30~11/2)						
共通担保(全店)			6	▲0.350	▲0.350	
CP等買入			0			
社債等買入			0			
共通担保(全店)(11/2~11/18)			20,000	1,601	1,601	

マナタリーベース	所要
10月29日時点 6,085,400	今積期の所要準備額 3,537,500
	11月2日以降の残り所要積数 300
	平均 0

### 国庫短期証券入札予定

10月30日	3ヶ月	第948回
11月6日	3ヶ月	
11月9日	6ヶ月	
11月13日	3ヶ月	
11月4日	10年	
11月6日	物価運動	
11月10日	30年	
11月12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	1,000~2,000	1,000	月2回程度	10月30日	2
1年超3年以下	3,500~6,500	4,200	5 11 17 24 26	10月30日	5
3年超5年以下	2,500~6,000	3,500	5 11 17 24 30	10月30日	5
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	9 11 17 24 26	10月30日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	9 26	10月26日	2
25年超	0~500	300	5 30	10月26日	2
物価運動債	300	300	月2回程度	10月21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。