

### 短期市場の推移

	9月30日	10月1日	10月2日	10月3日
加重平均金利	▲0.064	▲0.048	▲0.036	▲0.019
東京レポレート(ON)	▲0.116	▲0.097	▲0.073	▲0.052
無コール残	60,524	77,448	78,799	74,650
ON	45,044	56,643	58,194	52,010
その他	15,480	20,805	20,605	22,640
有コール残	14,574	21,082	21,376	20,075

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7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (9月30日現在)	-	(米)ミネアポリス 連銀総裁の講演	-
14:00	景気動向指数(8月)	-	-	-
15:00	コール市場残高(9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	▲0.070	0.001	▲0.011	▲0.049
T/N	-	-	-	▲0.048
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.057
2W	-	-	-	▲0.064
3W	-	-	0.000	▲0.074
1M	-	-	-	▲0.087
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.166
6M	-	-	-	▲0.186
1Y	-	-	-	▲0.204

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

### 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▲0.020%~▲0.005%の水準で取引された。週末3日積みとなることから昨日よりも調達意欲がさらに強まった。そのため同加重平均金利(速報)は前日対比+0.008%の▲0.011%と、2016年4月以来約3年半ぶりの高さとなった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.010		▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.005

### 翌営業日のマーケット

週明けも地合いは堅調で、出合いの水準は横ばいを予想。

### 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月4日	10月7日	10月8日
券	+600	+1,000	+1,000
財政	▲4,400	+3,300	+1,000
過不足	▲3,800	+4,300	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+4,600
共通担保(全店)		▲3,100	+1,600
CP等買入		▲100	
国債補完供給	+200	▲900	+900
当座預金増減	▲4,500	+8,200	+2,000
当座預金残高	3,995,400	4,003,600	4,005,600
準備預金残高	3,502,300	主な需給要因	
積み終了先	3,502,100	国庫短期証券	
超過準備	3,501,900	発行・償還	
非準備先残高	493,100	(3M)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	70.0%		
乖離率	29.9%		

### 10月4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(10/7~)						
~1年	500	1,719	500	0.015	0.030	17.6
5~10年	3,500	11,484	3,506	▲0.024	▲0.022	17.1
物価連動	250	1,863	250	▲0.080	▲0.148	10.6
国債補完供給(10/4~10/7)						
		848	848	▲0.250	▲0.250	
		1	1	▲0.250	▲0.250	
共通担保(全店)(10/7~10/21)						
	15,000	1,598	1,598			

マナタリーベース [億円]  
10月3日時点 5,119,400

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,085,600  
10月7日以降の残り所要積数 1,200  
平均 100

### 国庫短期証券入札予定

10月9日	6ヶ月	第862回
10月11日	3ヶ月	第863回
10月17日	1年	
10月18日	3ヶ月	
10月10日	30年	
10月17日	5年	
10月24日	20年	
10月29日	2年	

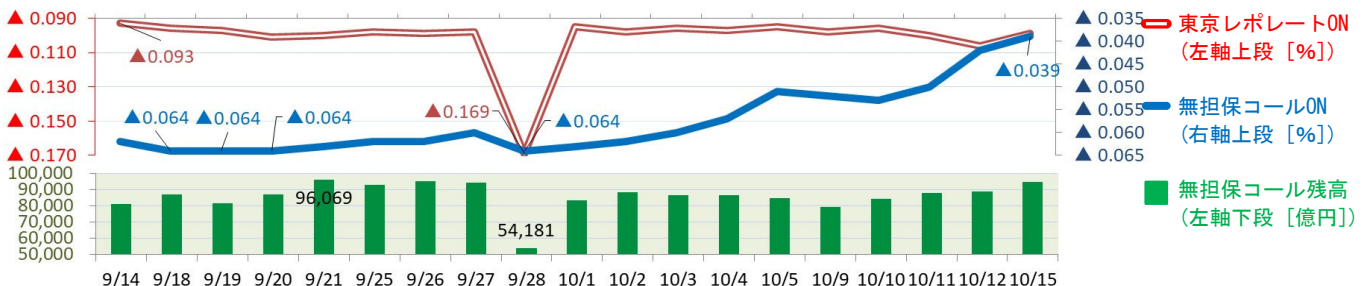
### 今月の国債買入オペ予定

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4日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 15 21 28	9月30日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	4 15 21 28	10月4日	3
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300	7 18 30	9月20日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	10月4日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	1

### 1年前の市場推移

○2018年9月積み期 [9月14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。投資については最終決定は、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。