

### 短期市場の推移

	10月11日	10月15日	10月16日	10月17日
加重平均金利	▲0.010	▲0.009	▲0.051	▲0.045
東京レポレート(ON)	▲0.054	▲0.076	▲0.094	▲0.083
無コール残	68,271	73,689	80,007	80,142
ON	45,601	51,009	58,112	58,687
その他	22,670	22,680	21,895	21,455
有コール残	19,627	19,816	19,771	19,973

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21日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	9月貿易収支	575億円	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.031	▲0.069
T/N	-	-	▲0.010	▲0.060
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.020	▲0.022	▲0.064
2W	▲0.025	▲0.020	▲0.024	▲0.070
3W	-	-	-	▲0.076
1M	▲0.025	▲0.015	▲0.020	▲0.086
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.149
6M	-	-	-	▲0.176
1Y	-	-	-	▲0.190

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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.025%の水準で取引された。昨日も堅調な地合いであったが、本日は3日積みであったため、さらにビッドサイドの調達意欲は強まり、同加重平均金利(速報)は前日対比+0.014%の▲0.031%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.040 ~ ▲0.025

### 翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は旺盛で、堅調な地合いになると予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月18日	10月21日	10月21日	10月23日	10月23日	10月23日
券	▲1,200		+0	+0	+0	
財政	▲10,700		+2,400	+2,000	+2,000	
過不足	▲11,900		+2,400	+2,000	+2,000	
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			+1,600			
共通担保(全店)			▲1,600	+3,600		
CP等買入	▲200		▲200			
社債等買入	▲100					
ETF買入		+1,200				
被災地金融機関支援	▲100	+100				
国債補充供給	+300	▲100	+100			
当座預金増減	▲10,800		+5,900	+2,000	+2,000	
当座預金残高	4,079,200		4,085,100	4,087,100	4,087,100	
準備預金残高	3,564,700		主な需給要因			
積み終了先	3,560,800					
超過準備	3,532,500					
非準備預金残高	514,500					
準備預金進捗率	99.3%		国庫短期証券 発行・償還 (3M・1Y)			
平均	16.1%					
乖離率	83.2%					

### 10月18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(10/21~)						
10~25年	1,200	3,845	1,211	0.008	0.009	54.3
25年~	300	1,059	303	0.009	0.010	81.7
国債補充供給(10/18~10/21)						
共通担保(全店)(10/21~11/5)						
15,000	3,598	3,598				

マネタリーベース [億円]  
10月17日時点 5,209,200

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,194,000  
10月21日以降の残り所要積数 20,900  
平均 800

### 国庫短期証券入札予定

10月25日	3ヶ月	第866回
11月1日	3ヶ月	
11月7日	6ヶ月	
11月8日	3ヶ月	
国債入札予定		
10月24日	20年	
10月29日	2年	
11月6日	10年	
11月8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	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	10月15日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	4 15 21 28	10月15日	2
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	10月18日	1
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	10月15日	0

### 1年前の市場推移

○2018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。