

### 短期市場の推移

	10月24日	10月25日	10月26日	10月29日
加重平均金利	▲0.057	▲0.069	▲0.071	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.121	▲0.152	▲0.140	▲0.129
無コール残	103,314	87,272	89,676	84,109
ON	66,479	54,057	55,911	50,344
その他	36,835	33,215	33,765	33,765
有コール残	14,100	14,411	14,131	14,186

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31日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	9月鉱工業生産指数[前月比] ▲0.3%	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比] -
	日銀金融政策決定会合の結果及び展望レポート		
-	黒田日銀総裁会見		

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	▲0.086	0.001	▲0.072	▲0.134
T/N	-	-	0.000	▲0.175
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.038	▲0.042	▲0.155
2W	▲0.035	▲0.010	▲0.023	▲0.152
3W	-	-	-	▲0.149
1M	▲0.020	0.020	▲0.013	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.159

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、▲0.080%の出合から始まり、その後は主に▲0.086%~▲0.04%のレンジで取引された。昨日に引続きビッドサイドが薄く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.085 ~ ▲0.040

### 翌営業日のマーケット

引続きビッドサイドが薄く、軟調な地合が継続するものと予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月30日	10月31日	10月31日	11月1日	11月1日	11月1日
券	▲400			+0		+0
財政	▲3,000			▲3,200		▲21,000
過不足	▲3,400			▲3,200		▲21,000
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
国庫短期証券買入				+1,000		
国債買入				+8,900		
CP等買入	▲300			+2,000		
社債等買入				▲100		
ETF買入		+200		+900		
国債補完供給	+300	▲400	+400			
当座預金増減	▲3,600		+8,200		▲21,000	
当座預金残高	3,962,500		3,970,700		3,949,700	
準備預金残高	3,456,700					
積み終了先	3,456,000					
超過準備	3,456,000					
非準預先残高	505,800					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	48.4%					
乖離率	51.4%					

### 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
国庫短期証券買入(10/31~)	1,000	5,332	1,004	0.000	0.003	2.0
国債買入(10/31~)						
1~3年	3,000	8,990	3,006	▲0.003	▲0.002	61.2
3~5年	3,500	9,183	3,504	▲0.003	▲0.002	49.6
10~25年	1,800	7,851	1,800	0.004	0.004	
25年~	500	2,310	503	▲0.005	▲0.003	30.0
米ドル資金供給(11/1~11/8)			0	0	2.700	2.700
国債補完供給(10/30~10/31)			52,956	433	▲0.600	▲0.600

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月29日時点 5,064,300	今積期の所要準備額 3,102,600
	10月31日以降の残り所要積数 6,200
	平均 400

### 国庫短期証券入札予定

11月2日	3ヶ月	第793回
11月8日	6ヶ月	
11月9日	3ヶ月	
11月16日	3ヶ月	
11月1日	10年	
11月6日	物価運動	
11月13日	30年	
11月15日	5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24日	0
1年超3年以下	2,000~4,000 程度	3,000			
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	3 12 17 26 30	10月30日	0
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	3 10 17 24 26	10月26日	0
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	500	5 12 19 24 30	10月30日	0
物価運動債	250 程度	250	月2回程度	10月19日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10月17日	0

### 1年前の市場推移

○2017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。