

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月27日	8月28日	8月31日	9月1日
加重平均金利	▲0.054	▲0.054	▲0.057	▲0.052
東京レポレート(ON)	▲0.077	▲0.080	▲0.084	▲0.089
無コール残	92,894	91,731	91,177	91,382
ON	58,761	57,798	59,004	60,209
その他	34,133	33,933	32,173	31,173
有コール残	19,141	19,032	21,739	21,037

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。

9月3日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 日銀当座預金増減要因 (9月見込み)	-	18:00 (欧)7月小売売上高[前月比]	-
-	-	21:30 (米)7月貿易収支	-517億米ドル
-	-	23:00 (米)8月ISM非製造業景況指数	57.2

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	▲0.087	0.001	▲0.051	▲0.086
T/N	-	-	▲0.001	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.020	▲0.033	▲0.085
2W	▲0.028	▲0.015	▲0.022	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.088
1M	-	-	0.010	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.097
6M	-	-	-	▲0.136
1Y	-	-	-	▲0.163

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▲0.045%の出合から始まり、その後は▲0.080%～▲0.030%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+0.001%の▲0.051%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.080	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.075 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続き地銀中心の出合となり、出合水準は概ね横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月2日	9月3日	9月4日
券	▲100	+100	+1,000
財政	▲43,700	▲8,000	▲8,000
過不足	▲43,800	▲7,900	▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+20,000		スタート
国債買入		+9,100	
CP等買入	▲200	▲400	
社債等買入	▲100	▲100	
ETF買入		+300	
国債補完供給	+100	+100	
成長基盤強化支援資金供給	▲3,000	+1,800	
米ドル資金供給用担保国債供給			+1,000
当座預金増減	▲25,300	+1,100	▲6,000
当座預金残高	4,593,600	4,594,700	4,588,700
準備預金残高	3,999,500	主な需給要因	
積み終了先	3,999,500		
超過準備	3,999,500		
非準備先残高	594,100		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	58.1%		
乖離率	41.8%		

9月2日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(9/3~)						
1~3年	4,200	13,284	4,205	0.001	0.002	51.8
3~5年	3,500	8,915	3,507	0.000	0.001	47.5
10~25年	1,200	4,218	1,212	0.002	0.003	17.2
国債補完供給(9/2~9/3)						
	132	132	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
9月1日時点 5,804,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,499,200
9月3日以降の残り所要	
積数	500
平均	0

国庫短期証券入札予定

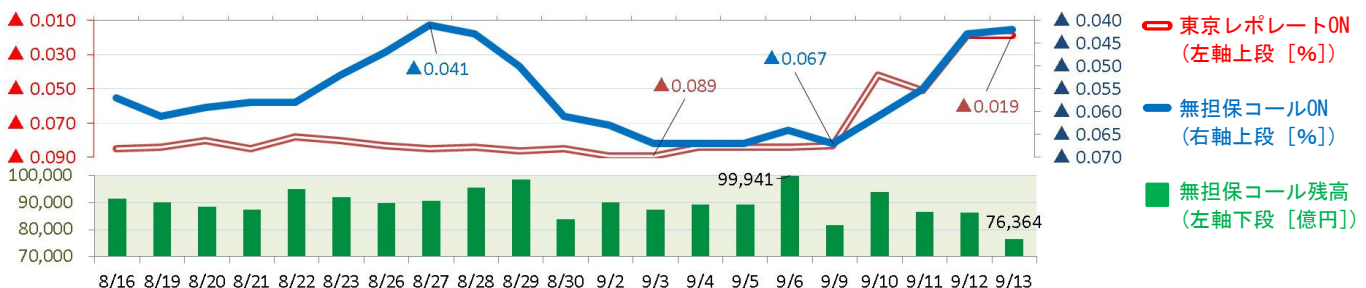
9月4日	3ヶ月	第934回
9月9日	6ヶ月	第935回
9月11日	3ヶ月	
9月16日	1年	
国債入札予定		
9月3日	30年	
9月8日	5年	
9月10日	20年	
9月24日	40年	

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	500~1,500	1,000	月3回程度	8月31日	3
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	2 7 11 16 23 28	9月2日	5
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	9月2日	5
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 23 28	8月26日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 14	9月2日	1
25年超	0~500	300	7 28	8月28日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	8月28日	2
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	月1回	8月5日	0

1年前の市場推移 ○2019年8月積み期 [8月16日~9月13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。