

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月28日	8月31日	9月1日	9月2日
加重平均金利	▲0.054	▲0.057	▲0.052	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.080	▲0.084	▲0.089	▲0.086
無コール残	91,731	91,177	91,382	96,601
ON	57,798	59,004	60,209	63,828
その他	33,933	32,173	31,173	32,773
有コール残	19,032	21,739	21,037	21,794

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4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	【記者会見要旨】片岡審議委員(9月3日)	-	-
-	-	21:30	(米)8月非農業部門雇用者数
-	-	21:30	(米)8月失業率
-	-	21:30	(米)8月平均時給[前年比]

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	▲0.058	▲0.111
T/N	-	-	▲0.001	▲0.117
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.020	▲0.035	▲0.095
2W	▲0.030	0.030	▲0.003	▲0.094
3W	-	-	0.020	▲0.096
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.137
1Y	-	-	-	▲0.164

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▲0.05%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▲0.007%の▲0.058%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.073	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.073 ~ ▲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3日	9月4日	9月7日
券	+100	+300	+1,000
財政	▲7,600	▲5,700	▲1,000
過不足	▲7,500	▲5,400	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲9,100	▲2,800	▲6,000
共通担保(全店)	▲400	▲600	
CP等買入	▲100	▲100	
社債等買入			
ETF買入	+300		
国債補完供給	+100	+200	
米ドル資金供給用担保国債供給		+1,000	
当座預金増減	+1,300	▲4,900	+3,200
当座預金残高	4,594,900	4,590,000	4,593,200
準備預金残高	3,973,800		
積み終了先	3,973,700		
超過準備	3,973,700		
非準備先残高	621,100		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	61.3%		
乖離率	38.6%		

9月3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
CP等買入(9/7~)	6,000	10,112	5,992	▲0.042	▲0.018	9.2
国債補完供給(9/3~9/4)	231	231	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
9月2日時点 5,779,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,499,200
9月4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	
9月8日	5年	
9月10日	20年	
9月24日	40年	
9月29日	2年	

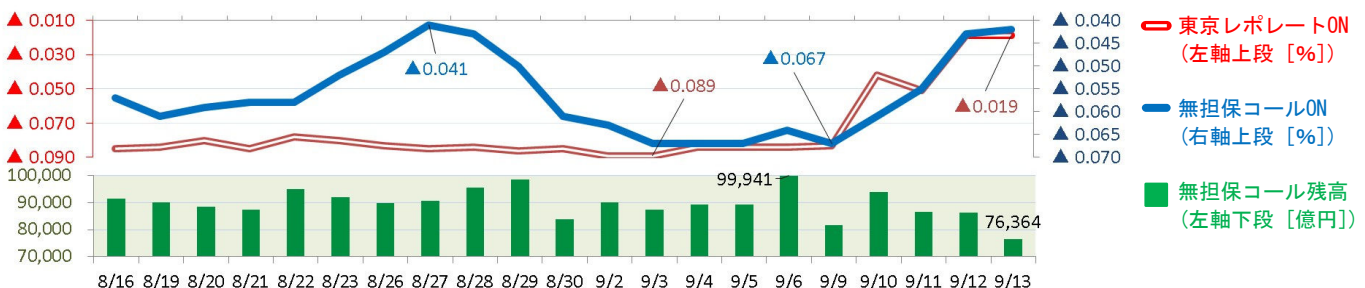
今月の国債買入オペ予定

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	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。