

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月3日	9月4日	9月7日	9月8日
加重平均金利	▲0.058	▲0.057	▲0.064	▲0.066
東京レポレート(ON)	▲0.111	▲0.106	▲0.127	▲0.167
無コール残	105,955	94,013	85,037	94,118
ON	70,987	57,245	47,419	54,160
その他	34,968	36,768	37,618	39,958
有コール残	20,767	19,748	17,450	17,855

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10日の予定(時刻は日本時間)

日本			海外		
		予想			予想
8:50	7月コア機械受注[前月比]	+2.0%	20:45	(欧)ECB理事会	0%
	-		21:30	(米)8月生産者物価コア指数[前年比]	-
	-		21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

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	▲0.070	▲0.104
T/N	▲0.066	▲0.001	▲0.014	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.020	▲0.042	▲0.107
2W	-	-	-	▲0.112
3W	-	-	-	▲0.121
1M	-	-	-	▲0.121
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.143
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▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.050%の水準で出合が見られた。昨日に引き続きビットサイドの調達に限定的だったため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.070%(5月29日以来、約3か月ぶりの▲0.07%台)となった。また、日銀は当座預金のマクロ加算残高にかかる基準比率の見直しについて、9月積み期間は24.0%(前回29.0%)とした。

	都銀・信託	証券	地銀
	-	▲ 0.087 ~ ▲ 0.087	▲ 0.087 ~ ▲ 0.050

翌営業日のマーケット

本日と同様に軟調な地合を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月9日	9月10日	9月11日
券	+700	+200	▲1,000
財政	▲20,900	▲8,800	▲10,000
過不足	▲20,200	▲8,600	▲11,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+10,000		
CP等買入	▲100	▲800	
社債等買入			+3,000
国債補完供給	+200	▲200	+200
当座預金増減	▲10,300	▲9,200	▲8,000
当座預金残高	4,596,900	4,587,700	4,579,700
準備預金残高	3,944,500		
積み終了先	3,944,500		
超過準備	3,944,500		
非準備先残高	652,400		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	80.6%		
乖離率	19.3%		

9月9日のオペ結果 [円][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
米ドル資金供給(9/11~9/17)		640	640	0.350	0.350	
米ドル資金供給(9/11~12/3)		585	585	0.330	0.330	
社債等買入(9/11~)	3,000	5,427	3,001	▲0.053	▲0.037	33.4
国債補完供給(9/9~9/10)	156	156	▲0.350	▲0.350		
	15	15	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月8日時点 5,791,000	今積期の所要準備額 3,516,000
	9月10日以降の残り所要
	積数 200
	平均 0

国庫短期証券入札予定

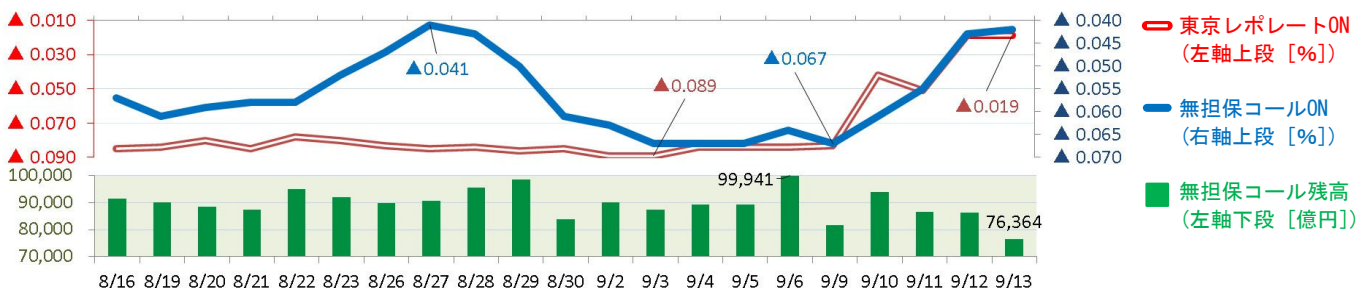
9月11日	3ヶ月	第936回
9月16日	1年	第937回
9月18日	3ヶ月	
9月24日	16ヶ月	
国債入札予定		
9月10日	20年	
9月24日	40年	
9月29日	2年	
10月1日	10年	

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	9月4日	2
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	2 7 11 16 23 28	9月7日	4
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	9月7日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 23 28	9月4日	4
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	9月7日	1
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	-

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。