

### 短期市場の推移

	9月8日	9月9日	9月10日	9月11日
加重平均金利	▲0.066	▲0.070	▲0.073	▲0.074
東京レポレート(ON)	▲0.167	▲0.104	▲0.094	▲0.102
無コール残	94,118	86,748	87,786	90,678
ON	54,160	47,350	49,368	52,130
その他	39,958	39,398	38,418	38,548
有コール残	17,855	21,609	25,091	21,461

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15日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	FOMC(16日まで)	-
-	-	21:30 (米)9月ニューヨーク連銀 製造業景気指数	6.0
-	-	22:15 (米)8月鉱工業生産指数 [前月比]	1.0%

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	▲0.072	▲0.088
T/N	-	-	▲0.001	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.000	▲0.033	▲0.098
2W	▲0.045	0.001	▲0.035	▲0.102
3W	-	-	0.100	▲0.112
1M	-	-	0.020	▲0.117
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.120
6M	-	-	-	▲0.144
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%~▲0.040%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+0.002%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.080	- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.035

### 翌営業日のマーケット

明日は積み最終日となり調整で調達を行う先が増え、出合水準は若干上昇を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月14日	9月15日	9月15日	9月16日	9月16日	9月17日
券		+0	▲100	+0	+0	
財政		▲29,700	+2,800	▲4,000		
過不足		▲29,700	+2,700	▲4,000		
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		+12,000	+1,800			
CP等買入	▲900		▲1,100			
社債等買入	▲100					
ETF買入		+700				
国債補完供給	+100	▲800	+800			
米ドル支援供給用担保国債供給	+9,000					
貸出増加支援資金供給				▲49,500	+132,300	
当座預金増減		▲9,700	+4,200	+78,800		
当座預金残高		4,568,300	4,572,500	4,651,300		
準備預金残高		3,961,600	主な需給要因			
積み終了先		3,961,500				
超過準備		3,961,500				
非準備先残高		606,700				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		96.8%				
乖離率		3.2%				

### 9月14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(9/15~)						
10~25年	1,200	4,207	1,217	0.001	0.002	10.3
物価連動	300	1,789	300	▲0.200	▲0.243	20.0
国債補完供給(9/14~9/15)						
		819	819	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース	所要
9月11日時点 5,760,400	今積期の所要準備額 3,516,000
	9月15日以降の残り所要積数 0
	平均 0

### 国庫短期証券入札予定

9月16日	1年	第937回
9月18日	3ヶ月	第938回
9月24日	6ヶ月	
9月25日	3ヶ月	
9月24日	40年	
9月29日	2年	
10月1日	10年	
10月6日	30年	

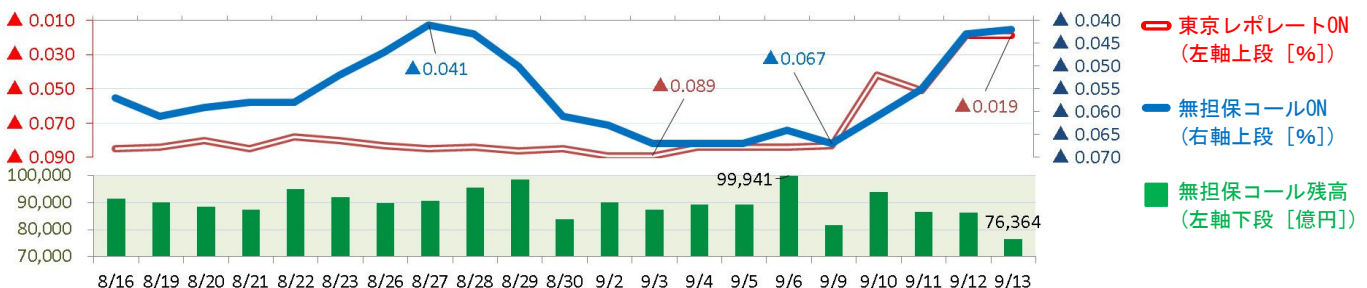
### 今月の国債買入オペ予定

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11日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	9月11日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 23 28	9月11日	3
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 14	9月14日	0
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	9月14日	1
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。