

短期市場の推移

[億円][%]

| | 9月16日 | 9月17日 | 9月18日 | 9月23日 |
|-------------|---------|---------|---------|---------|
| 加重平均金利 | ▲0.056 | ▲0.051 | ▲0.046 | ▲0.046 |
| 東京レポレート(ON) | ▲0.083 | ▲0.089 | ▲0.090 | ▲0.091 |
| 無コール残 | 102,494 | 107,876 | 108,873 | 113,951 |
| ON | 64,596 | 69,378 | 68,580 | 75,418 |
| その他 | 37,898 | 38,498 | 40,293 | 38,533 |
| 有コール残 | 19,936 | 20,050 | 21,069 | 20,790 |

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25日の予定(時刻は日本時間)

| 日本 | | 予想 | 海外 | | 予想 |
|------|----------------------|----|-------|---------------------|------|
| 8:50 | 企業向けサービス 価格指数(8月) | - | 21:30 | (米)8月耐久財受注 [前月比] | 1.0% |
| | 国債市場特別 参加者会合 | | | - | |
| | - | | | - | |

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

本日の市況

| | 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 | ▲0.038 | ▲0.102 |
| T/N | ▲0.038 | ▲0.015 | ▲0.035 | ▲0.103 |
| S/N | - | - | - | - |
| 1W | ▲0.040 | 0.300 | 0.048 | ▲0.108 |
| 2W | - | - | - | ▲0.108 |
| 3W | - | - | ▲0.030 | ▲0.109 |
| 1M | - | - | - | ▲0.114 |
| 2M | - | - | - | - |
| 3M | - | - | - | ▲0.121 |
| 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

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.015%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+0.008%の▲0.038%となった。
昨日23日の無担保コール市場残高が7月10日以来約2か月ぶりに11兆円台となった。

| 都銀・信託 | 証券 | 地銀 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| ▲0.065 ~ ▲0.050 | ▲0.055 ~ ▲0.050 | ▲0.060 ~ ▲0.015 |

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲が強く、堅調な地合を想定。

資金需給

[億円]

| | 日銀速報 | | 日銀予想 | | 当社需給予想 | |
|---------------|-----------|-----------|------------------|-----------|--------|---------------------|
| | 9月24日 | 9月25日 | 9月24日 | 9月25日 | 9月28日 | 9月29日 |
| 券 | ▲100 | ▲700 | | ▲700 | | +1,000 |
| 財政 | +2,500 | ▲35,900 | | ▲35,900 | | +6,000 |
| 過不足 | +2,400 | ▲36,600 | | ▲36,600 | | +7,000 |
| 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 | | +10,000 | | | | |
| 国債買入 | | +13,100 | | | | |
| CP等買入 | ▲500 | | ▲2,000 | | | |
| 社債等買入 | | | | +2,000 | | |
| ETF買入 | | | | +200 | | |
| 国債補完供給 | +100 | ▲200 | +200 | | | |
| 新型コロナ対応金融支援特別 | | | | +99,900 | | |
| 当座預金増減 | +24,900 | +63,700 | | +63,700 | | +7,000 |
| 当座預金残高 | 4,811,300 | 4,875,000 | | 4,875,000 | | 4,882,000 |
| 準備預金残高 | 4,171,100 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,170,900 | | | | | |
| 超過準備 | 4,170,200 | | | | | |
| 非準備先残高 | 640,200 | | | | | |
| 準備預金進捗率 | 99.9% | | | | | |
| 平均 | 30.0% | | | | | |
| 乖離率 | 69.9% | | | | | |
| | | | 国債発行 (40年) | | | 国庫短期証券 発行・償還(3M) |
| | | | 国庫短期証券 発行(6M) | | | |

9月24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 | 接分 |
|--------------------------|--------|--------|--------|--------|----|----|
| 国債補完供給(9/24~9/25) | 188 | 188 | ▲0.350 | ▲0.350 | | |
| 新型コロナ対応金融支援特別(9/25~3/25) | 0 | 0 | | | | |
| | 99,869 | 99,869 | | | | |

マナタリーベース [億円]
9月23日時点 5,971,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,409,900
9月25日以降の残り所要
積数 5,100
平均 200

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

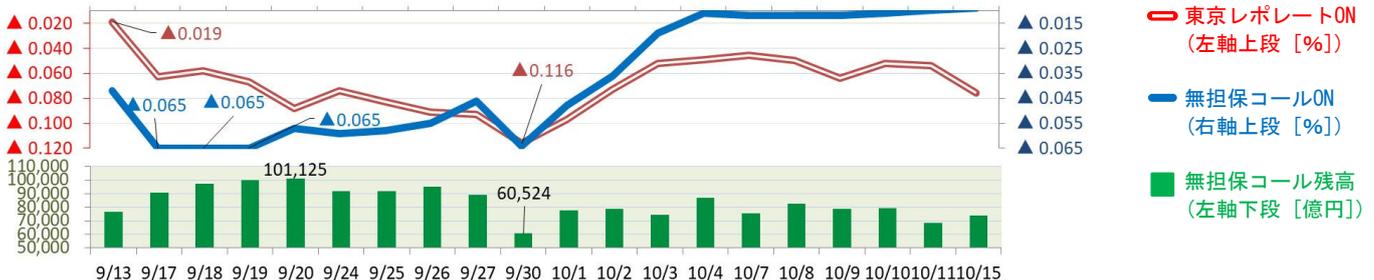
| | | |
|-------|-----|-------|
| 9月25日 | 3ヶ月 | 第940回 |
| 10月2日 | 3ヶ月 | |
| 10月8日 | 6ヶ月 | |
| 10月9日 | 3ヶ月 | |
| 9月29日 | 2年 | |
| 10月1日 | 10年 | |
| 10月6日 | 30年 | |
| 10月8日 | 5年 | |

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

1年前の市場推移

○2019年9月積み期 [9月13日~10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。