

短期市場の推移

	8月27日	8月28日	8月29日	8月30日
加重平均金利	▲0.041	▲0.043	▲0.050	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.084	▲0.086	▲0.085
無コール残	90,565	95,440	98,505	83,938
ON	55,620	59,665	62,200	53,393
その他	34,945	35,775	36,305	30,545
有コール残	19,692	20,343	18,648	21,043

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	マナターベース(8月)	-	23:00 (米)8月ISM製造業景況指数	51.3
10:00	日銀営業毎旬報告(8月31日現在)	-	(米)8月製造業PMI確報	
			(米)ホスト連銀総裁の講演	

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	▲0.080	0.001	▲0.063	▲0.089
T/N	-	-	-	▲0.117
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.040	▲0.044	▲0.112
2W	-	-	0.000	▲0.113
3W	-	-	-	▲0.116
1M	-	-	-	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.157
1Y	-	-	-	▲0.168

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.065%の出合から始まった。その後は、主に▲0.070%~▲0.050%の水準で取引された。月末の地合を受けて弱含む展開となり、同加重平均金利(速報)は▲0.063%(前営業日対比▲0.002%)に低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

地合に大きな変化はなく、引き続き軟調な地合を予想する。

資金需給

	日銀速報 9月2日	日銀予想 9月3日	当社需給予想 9月4日
券	+700	+600	+0
財政	▲33,800	▲13,700	▲57,000
過不足	▲33,100	▲13,100	▲57,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+12,400	+2,100	
共通担保(全店)	▲2,300		
CP等買入	▲100	▲100	
社債等買入	▲100	▲100	
ETF買入		+200	
国債補完供給	+300		
成長基盤強化支援		▲3,500	▲100
当座預金増減	▲20,700	▲12,600	▲57,100
当座預金残高	4,015,800	4,003,200	3,946,100
準備預金残高	3,490,500	主な需給要因	
積み終了先	3,490,200		
超過準備	3,490,200		
非準備先残高	525,300		
準備預金進捗率	99.9%		国債発行(10年) 税・保険揚げ 普通交付税 交付金
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	接分
国債買入(9/3~)						
10~25年	1,400	4,999	1,406	0.013	0.014	49.2
25年~	400	1,437	406	0.012	0.014	49.6

国庫短期証券入札予定

9月6日	3ヶ月	第855回
9月9日	6ヶ月	第856回
9月13日	3ヶ月	
9月18日	1年	
9月3日	10年	
9月5日	30年	
9月11日	5年	
9月18日	20年	

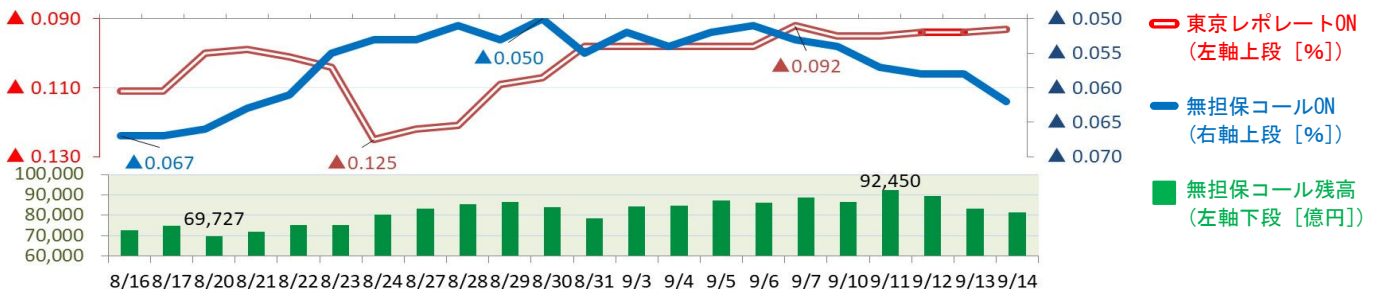
今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	8月30日	2
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	4,000		8月30日	4
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	6 17 24 30	8月30日	4
5年超10年以下	2,500~5,500 程度	4,000	6 12 20 26	8月30日	4
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,400		9月2日	2
25年超	100~1,000 程度	400	2 12 20		
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月26日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	-

1年前の市場推移

○2018年8月積み期 [8月16日~9月14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。