

短期市場の推移

	9月5日	9月6日	9月9日	9月10日
加重平均金利	▲0.067	▲0.064	▲0.067	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.084	▲0.083	▲0.042
無コール残	89,299	99,941	81,666	94,004
ON	55,089	66,296	49,061	61,399
その他	34,210	33,645	32,605	32,605
有コール残	25,836	25,453	21,971	23,113

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12日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	8月国内企業物価指数 [前年比]	▲0.8%	20:45	(欧)9月 ECB政策金利	0.0%
8:50	企業物価指数(8月)	-	21:30	(米)8月消費者物価 コア指数 [前年比]	2.3%
			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	▲0.080	0.001	▲0.055	▲0.051
T/N	-	-	-	▲0.052
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.076
2W	▲0.040	▲0.020	▲0.022	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.137
6M	-	-	-	▲0.167
1Y	-	-	-	▲0.173

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、▲0.06%の出合から始まり、その後は▲0.07%~▲0.035%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの資金調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は前営業日+0.006%の▲0.055%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.060 ~ ▲0.050	▲0.060 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは強く、出合水準は本日対比上昇すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月11日	9月12日	9月12日	9月13日	9月13日
券	+700	▲500	▲500	▲1,000	▲1,000
財政	▲600	▲21,800	▲21,800	▲1,000	▲1,000
過不足	+100	▲22,300	▲22,300	▲2,000	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+5,000	
CP等買入	▲200	▲300	▲300		
社債等買入		▲100	▲100		
ETF買入	+500				
国債補完供給	▲100	+100	+100		
当座預金増減	+300	▲17,600	▲17,600	▲2,000	▲2,000
当座預金残高	3,973,600	3,956,000	3,956,000	3,954,000	3,954,000
準備預金残高	3,465,400				
積み終了先	3,465,100				
超過準備	3,465,100				
非準備先残高	508,200				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	87.1%				
乖離率	12.8%				

9月11日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(9/12~)	5,000	14,343	5,000	0.002	0.006	4.0
CP等買入(9/17~)	4,000	7,550	3,988	▲0.009	▲0.006	58.0
国債補完供給(9/11~9/12)		128	128	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース	所要
9月10日時点 5,092,600	今積期の所要準備額 3,182,200
	9月12日以降の残り所要積数 300
	平均 100

国庫短期証券入札予定

9月13日	3ヶ月	第857回
9月18日	1年	第858回
9月20日	3ヶ月	
9月27日	3ヶ月	
9月18日	20年	
9月25日	40年	
9月27日	2年	
10月1日	10年	

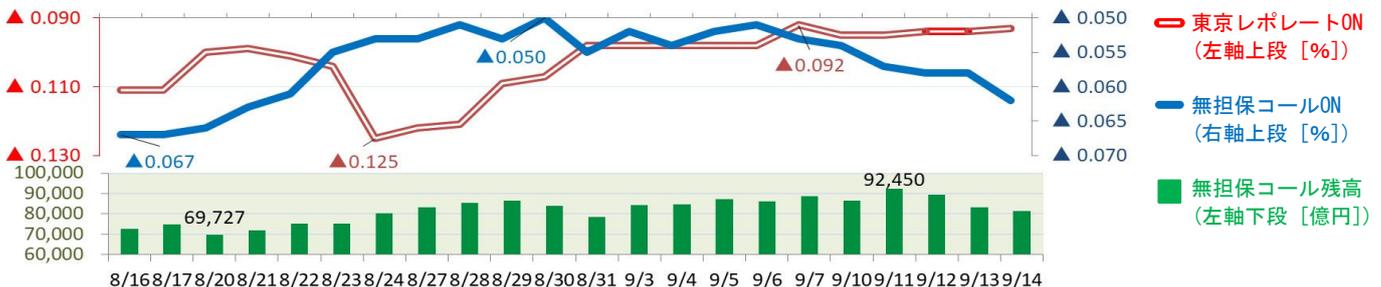
今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	9月6日	1
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	4,000			
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	6 17 24 30	9月6日	3
5年超10年以下	2,500~5,500 程度	4,000	6 12 20 26	9月6日	3
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,400			
25年超	100~1,000 程度	400	2 12 20	9月2日	2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	9月6日	1
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。