

短期市場の推移

	9月6日	9月9日	9月10日	9月11日
加重平均金利	▲0.064	▲0.067	▲0.061	▲0.055
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.083	▲0.042	▲0.051
無コール残	99,941	81,666	94,004	86,514
ON	66,296	49,061	61,399	54,709
その他	33,645	32,605	32,605	31,805
有コール残	25,453	21,971	23,113	22,179

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:00 (欧)7月貿易収支	-
-	-	21:30 (米)8月小売売上高	0.3%
-	-	23:00 (米)9月ミシガン大消費者信頼感指数速報	90.2

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	▲0.043	▲0.019
T/N	-	-	-	▲0.041
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.069
2W	-	-	▲0.018	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.112
1M	-	-	-	▲0.114
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.030	▲0.138
6M	-	-	-	▲0.167
1Y	-	-	-	▲0.174

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、▲0.05%の出合から始まり、その後は▲0.065%~▲0.025%の水準で取引された。引き続きビッド水準を切り上げて調達に動く先が多く、同加重平均金利(速報)は前営業日+0.012%の▲0.043%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.045	▲0.050 ~ ▲0.030	▲0.065 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

来積み期にもかかる取引となることから、調達サイドの一部は慎重な動きとなることが予想される。

資金需給

	日銀速報 9月12日	日銀予想 9月13日	当社需給予想 9月17日
券	▲600	▲100	+1,000
財政	▲21,800	+1,800	+11,000
過不足	▲22,400	+1,700	+12,000
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	+5,000		
国債買入		+6,100	
共通担保(全店)			▲2,200
CP等買入	▲300	▲400	+4,000
社債等買入	▲100	▲100	
国債補完供給	+100		
貸出増加支援			▲7,300 +13,000
当座預金増減	▲17,700	+7,300	+19,500
当座預金残高	3,955,900	3,963,200	3,982,700
準備預金残高	3,437,200	主な需給要因	
積み終了先	3,437,000	国債償還(2年)	
超過準備	3,437,000	国庫短期証券	
非準備先残高	518,700	発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	99.9%	個人向け国債	
平均	90.3%	発行・償還	
乖離率	9.6%		

9月12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(9/13~)						
5~10年	4,000	7,579	4,002	0.004	0.006	9.8
10~25年	1,400	4,248	1,401	0.007	0.009	97.7
25年~	400	1,734	402	0.009	0.009	77.5
国債補完供給(9/12~9/13)						
		43	43	▲0.250	▲0.250	

マナタリーベース [億円]
9月11日時点 5,092,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,182,200
9月13日以降の残り所要積数 100
平均 0

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	

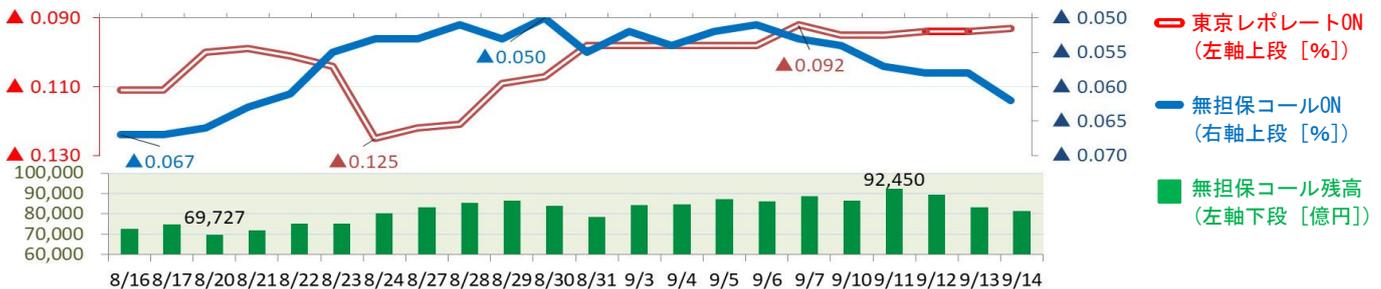
今月の国債買入オペ予定

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	2,500~5,000 程度	4,000	6 12 20 26	9月12日	2
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12日	1
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。