

### 短期市場の推移

	9月10日	9月11日	9月12日	9月13日
加重平均金利	▲0.061	▲0.055	▲0.043	▲0.042
東京レポレート(ON)	▲0.042	▲0.051	▲0.019	▲0.019
無コール残	94,004	86,514	86,329	76,364
ON	61,399	54,709	54,604	47,789
その他	32,605	31,805	31,725	28,575
有コール残	23,113	22,179	20,016	21,858

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18日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	8月貿易収支	-3463億円	5:00	(米)7月対米証券投資収支(ネット長期TICフロー)	-
	日銀金融政策決定会合(1日目)		21:30	(米)8月住宅着工件数	125.5万戸
			21:30	(米)8月住宅建設許可件数	132.0万戸

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	▲0.065	▲0.063
T/N	-	-	-	▲0.062
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.015	▲0.035	▲0.073
2W	-	-	▲0.020	▲0.102
3W	-	-	-	▲0.107
1M	-	-	▲0.040	▲0.112
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.163
1Y	-	-	-	▲0.171

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▲0.08%~▲0.040%の水準で取引された。新積み期に入り調達サイドが慎重な姿勢となったことから同加重平均金利(速報)は前営業日▲0.023%の▲0.065%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.065	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.040

### 翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に変化はなく、出合の水準は横ばいと予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月17日	9月18日	9月17日	9月18日	9月19日	9月19日
券	+1,100	+500		+500		▲1,000
財政	+2,100	+2,100		+2,100		▲11,000
過不足	+3,200	+2,600		+2,600		▲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
国債買入				+7,700		
共通担保(全店)	▲2,200	+2,200				
CP等買入	▲700	+4,000		▲200		
ETF買入				+700		
国債補完供給	+100	▲200	+200			
貸出増加支援	▲4,800	+13,000				
当座預金増減		+14,600		+11,000		▲12,000
当座預金残高		3,974,500		3,985,500		3,973,500
準備預金残高		3,489,100				
積み終了先		3,412,300				
超過準備		3,023,800				
非準備先残高		485,400				
準備預金進捗率		96.0%				
平均		6.7%				
乖離率		89.4%				

### 9月17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(9/18~)								
1~3年	4,000	13,405	4,005	▲0.005	▲0.005	88.2		
3~5年	3,600	10,047	3,605	▲0.012	▲0.010	23.0		
米ドル資金供給(9/19~9/26)			3	3	2.460	2.460		
社債等買入(9/24~)			1,250	2,910	1,250	▲0.067	▲0.054	96.4
国債補完供給(9/17~9/18)			177	177	▲0.350	▲0.350		
米ドル資金供給用担保国債供給(9/18~9/27)			5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース	所要
9月13日時点 5,079,100	今積期の所要準備額 3,081,200
	9月18日以降の残り所要積数 122,100
	平均 4,400

### 国庫短期証券入札予定

9月18日	1年	第858回
9月20日	3ヶ月	第859回
9月27日	3ヶ月	
10月4日	3ヶ月	

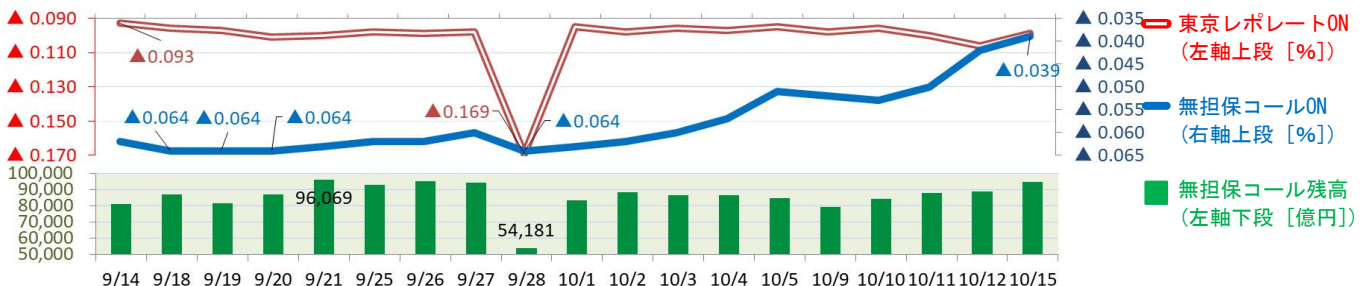
### 今月の国債買入オペ予定

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17日	2
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9月積み期 [9月14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。