

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月12日	9月13日	9月17日	9月18日
加重平均金利	▲0.043	▲0.042	▲0.065	▲0.065
東京レポレート(ON)	▲0.019	▲0.019	▲0.063	▲0.058
無コール残	86,329	76,364	90,655	97,544
ON	54,604	47,789	60,560	66,079
その他	31,725	28,575	30,095	31,465
有コール残	20,016	21,858	23,051	23,453

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。

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	▲0.067
T/N	-	-	▲0.015	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	0.230	▲0.025	▲0.084
2W	-	-	0.030	▲0.106
3W	-	-	-	▲0.108
1M	-	-	▲0.040	▲0.111
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.162
1Y	-	-	-	▲0.170

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

9月20日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	8月消費者物価コア指数 [前年比]	+0.5%	-	-	-
-	【記者会見】黒田総裁(9月19日)	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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、その後は主に▲0.08%～▲0.040%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.065%となった。
本日結果が公表された金融政策決定会合では政策の現状維持が決定された。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075		▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

週末4日積みとなることで、調達サイドの動きが活発になり出合の水準は上昇する見込み。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月19日	9月20日	9月24日
券	▲1,100	▲700	+0
財政	▲9,400	+124,900	▲3,000
過不足	▲10,500	+124,200	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲400	▲800	
社債買入		▲1,100	
被災地金融機関支援		▲800	
国債補完供給	+300	+200	+800
当座預金増減	▲10,800	+122,500	▲3,000
当座預金残高	3,973,400	4,095,900	4,092,900
準備預金残高	3,451,800	主な需給要因	
積み終了先	3,436,000	国債償還	
超過準備	3,427,400	(5年10年20年変動15年)	
非準備先残高	521,600	国庫短期証券発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	98.7%	国庫短期証券発行・償還(1Y)	
平均	13.3%		
乖離率	85.4%		

9月19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	按分
国債補完供給(9/19~9/20)	143	143	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
9月18日時点 5,102,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,081,200
9月20日以降の残リ所要	
積数	38,900
平均	1,500

国庫短期証券入札予定

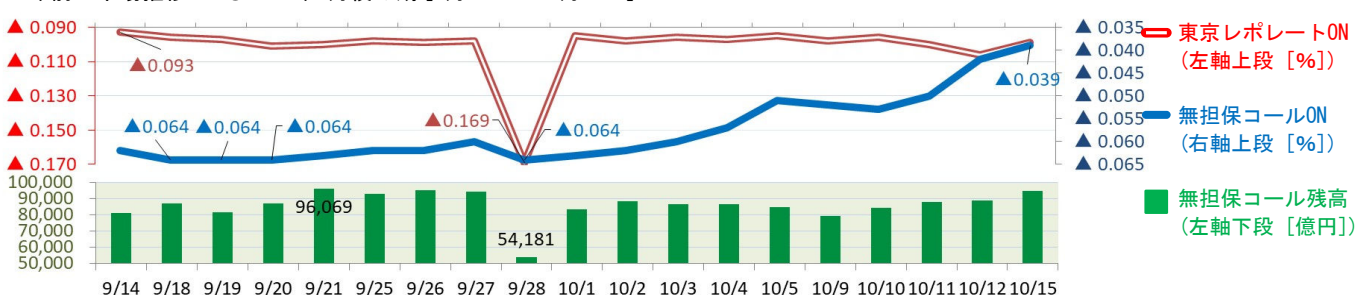
9月20日	3ヶ月	第859回
9月27日	3ヶ月	
10月4日	3ヶ月	
10月9日	6ヶ月	
国債入札予定		
9月25日	40年	
9月27日	2年	
10月1日	10年	
10月10日	30年	

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