

短期市場の推移

	9月13日	9月17日	9月18日	9月19日
加重平均金利	▲0.042	▲0.065	▲0.065	▲0.065
東京レポレート(ON)	▲0.019	▲0.063	▲0.058	▲0.067
無コール残	76,364	90,655	97,544	100,072
ON	47,789	60,560	66,079	67,177
その他	28,575	30,095	31,465	32,895
有コール残	21,858	23,051	23,453	22,275

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24日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:35	【挨拶】黒田総裁(大阪)	17:00	(独)8月IFO企業景況感指数 94.8
-	-	22:00	(米)7月S&P/コアロジックCS20都市住宅価格指数[前年比] -
-	-	23:00	(米)9月消費者信頼感指数 133.5

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	▲0.057	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.035	▲0.043	▲0.112
2W	-	-	-	▲0.112
3W	-	-	-	▲0.111
1M	-	-	-	▲0.114
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.166
1Y	-	-	-	▲0.177

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、▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.035%の水準で取引された。週末4日積み要因で地合は強含み、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.008%の▲0.057%となった。
 なお、昨日の無担保コール市場残高は7月24日以来、約2か月ぶりに10兆円を超えた。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

引き続き堅調な地合を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月20日	9月24日	9月24日	9月25日	9月25日	9月25日
券		▲700		+300		+0
財政		+125,100		▲3,300		▲2,000
過不足		+124,400		▲3,000		▲2,000
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				+5,600		
共通担保(全店)				▲500		+3,100
CP等買入				▲600		
社債等買入						+1,300
ETF買入						+800
被災地金融機関支援	▲800	+800				
国債補充供給	+200	▲500		+500		
当座預金増減		+122,200		+7,200		▲2,000
当座預金残高		4,095,600		4,102,800		4,100,800
準備預金残高		3,569,400				
積み終了先		3,568,100				
超過準備		3,563,600				
非準備先残高		526,200				
準備預金進捗率		99.5%				
平均		26.7%				
乖離率		72.8%				

9月20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(9/24~)						
5~10年	3,800	6,607	3,804	0.018	0.021	75.2
10~25年	1,200	1,860	1,201	0.025	0.031	74.8
25年~	300	936	301	0.055	0.058	76.6
国債補充供給(9/20~9/24)						
共通担保(全店)						
464		464	▲0.350	▲0.350		
70		70	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(9/24~10/7)						
15,000		3,058	3,058			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月19日時点 5,092,300	今積期の所要準備額 3,081,200
	9月24日以降の残り所要積数 15,700
	平均 700

国庫短期証券入札予定

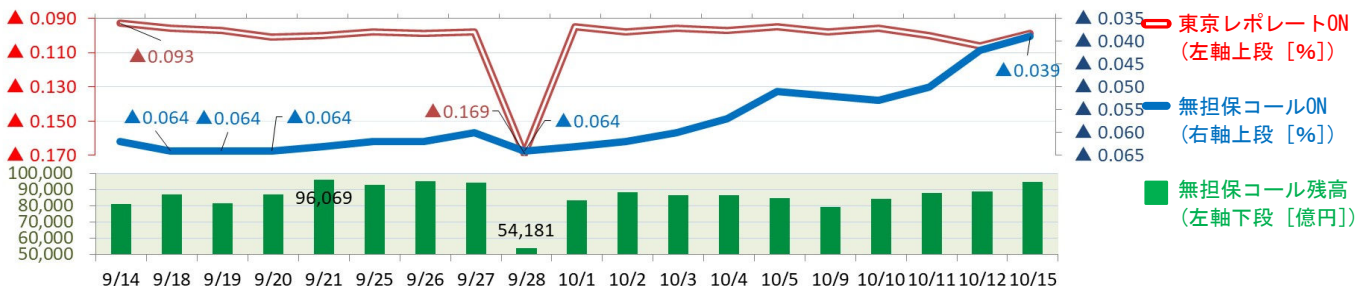
9月27日	3ヶ月	第860回
10月4日	3ヶ月	
10月9日	6ヶ月	
10月11日	3ヶ月	
9月25日	40年	
9月27日	2年	
10月1日	10年	
10月10日	30年	

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			
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	3,800	6 12 20 26	9月20日	1
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,200			
25年超	100~1,000 程度	300	2 12 20	9月20日	0
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。