

短期市場の推移

	9月18日	9月19日	9月20日	9月24日
加重平均金利	▲0.065	▲0.065	▲0.057	▲0.059
東京レポレート(ON)	▲0.058	▲0.067	▲0.088	▲0.074
無コール残	97,544	100,072	101,125	92,020
ON	66,079	67,177	69,210	61,715
その他	31,465	32,895	31,915	30,305
有コール残	23,453	22,275	21,039	23,018

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26日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
15:35	【挨拶】黒田総裁 (全国証券大会)	21:30	(米)4-6月期 GDP確報値 [前期比年率]
-	【記者会見】 政井審議委員 (9月25日)	21:30	(米)新規失業保険 申請件数(前週分)
-	-	-	セントリス連銀総裁の講演

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	▲0.085	0.001	▲0.058	▲0.083
T/N	-	-	▲0.058	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.117
2W	-	-	▲0.020	▲0.113
3W	-	-	-	▲0.112
1M	-	-	-	▲0.116
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.166
1Y	-	-	-	▲0.180

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、▲0.065%の合出から始まり、その後は主に▲0.085~▲0.035%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+0.001%の▲0.058%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に変化はなく、合出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25日	9月26日	9月26日	9月27日	9月27日	9月28日
券		+400	▲1,200			+0
財政		▲2,000	▲9,400			▲6,000
過不足		▲1,600	▲10,600			▲6,000
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				+7,500		
国債買入		+8,200				
CP等買入	▲800		▲700			
社債等買入	▲100		▲300			
国債補完供給	+500	▲1,100	+1,100			
当座預金増減		+5,100	▲3,000			▲6,000
当座預金残高		4,101,000	4,098,000			4,092,000
準備預金残高		3,563,000				
積み終了先		3,561,400				
超過準備		3,561,400				
非準備先残高		538,000				
準備預金進捗率		99.6%				
平均		33.3%				
乖離率		66.3%				

9月25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(9/26~)	7,500	25,843	7,501	0.005	0.006	99.9
CP等買入(9/30~)	4,000	8,020	3,985	▲0.005	▲0.001	58.9
国債補完供給(9/25~9/26)		1,059	1,059	▲0.350	▲0.359	
		10	10	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース	所要
9月24日時点 5,215,200	今積期の所要準備額 3,081,200
	9月26日以降の残り所要積数 12,800
	平均 600

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27日	2年	
10月1日	10年	
10月10日	30年	
10月17日	5年	

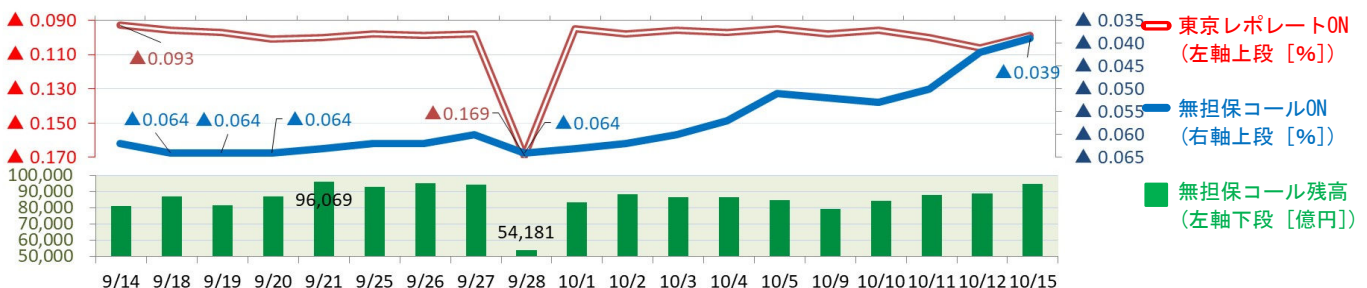
今月の国債買入オペ予定

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24日	0
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	4,000		9月24日	1
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	6 17 24 30	9月24日	1
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		9月20日	0
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。