

短期市場の推移

[億円][%]

	9月20日	9月24日	9月25日	9月26日
加重平均金利	▲0.057	▲0.059	▲0.058	▲0.055
東京レポレート(ON)	▲0.088	▲0.074	▲0.083	▲0.091
無コール残	101,125	92,020	91,954	95,092
ON	69,210	61,715	60,939	63,657
その他	31,915	30,305	31,015	31,435
有コール残	21,039	23,018	21,232	21,135

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30日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	8月鉱工業生産指数 [前月比]	▲0.5%	22:45 (米)9月MNIシカゴ購買部 協会景気指数	50.0
8:50	金融政策決定会合に おける主な意見 (9月18・19日分)	-	-	-
19:30頃	日銀当座預金増減要因と 金融調節(9月実績速報)	-	-	-

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

本日の市況

	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	▲0.046	▲0.093
T/N	-	-	▲0.075	▲0.113
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.001	▲0.017	▲0.112
2W	-	-	▲0.010	▲0.110
3W	-	-	-	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.117
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.167
1Y	-	-	-	▲0.181

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

本日の無担保コールON物は、▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.060~▲0.030%の水準で取引された。週末3日積み要因で調達意欲が強まり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.009%の▲0.046%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.045	▲0.070 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

四半期末初物となるため、ビッドが薄く、出合水準は低下すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 9月27日	日銀予想 9月30日	当社需給予想 10月1日
券	▲800	+200	+1,000
財政	▲13,500	▲3,700	▲21,000
過不足	▲14,300	▲3,500	▲20,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+4,000	
共通担保(全店)		▲2,200	+2,200
CP等買入	▲600	▲4,400	+4,000
国債補完供給	+500	▲400	+400
当座預金増減	▲10,800	▲3,500	▲20,000
当座預金残高	4,086,800	4,083,300	4,063,300
準備預金残高	3,550,400	主な需給要因	
積み終了先	3,549,200	国庫短期証券 発行・償還 (3M)	
超過準備	3,549,200	国債発行(2年)	
非準預先残高	536,400		
準備預金進捗率	99.7%		
平均	46.7%		
乖離率	53.1%		

9月27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
国債補完供給(9/27~9/30)	376	376	▲0.350	▲0.350		
	3	3	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(9/30~10/15)	15,000	2,238	2,238			

マナタリーベース [億円]
9月26日時点 5,217,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,081,300
9月30日以降の残り所要
積数 8,200
平均 500

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

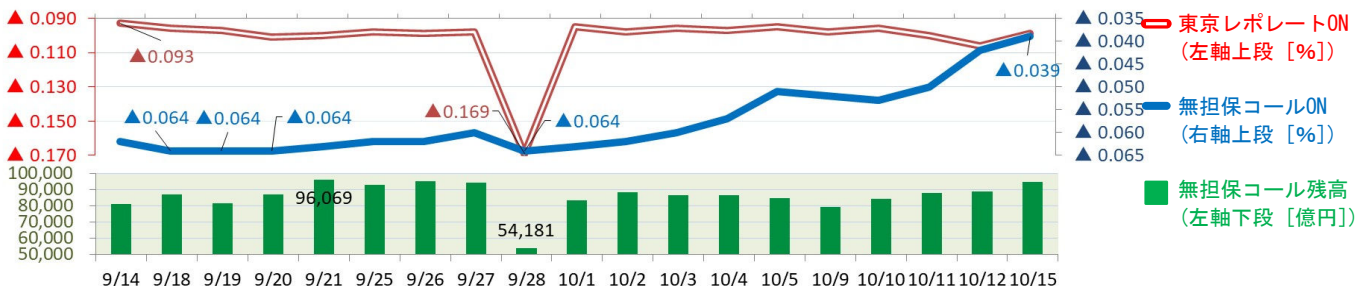
10月4日	3ヶ月	第861回
10月9日	6ヶ月	
10月11日	3ヶ月	
10月17日	1年	
10月1日	10年	
10月10日	30年	
10月17日	5年	
10月24日	20年	

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			
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	3,500	6 12 20 26	9月26日	0
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26日	0
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。