

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月24日	9月25日	9月26日	9月27日
加重平均金利	▲0.059	▲0.058	▲0.055	▲0.046
東京レポレート(ON)	▲0.074	▲0.083	▲0.091	▲0.093
無コール残	92,020	91,954	95,092	88,919
ON	61,715	60,939	63,657	59,374
その他	30,305	31,015	31,435	29,545
有コール残	23,018	21,232	21,135	20,995

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。

10月1日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:30	8月失業率	+2.3%	18:00	(欧)9月消費者物価コア指数[前年比]	1.0%
8:50	7-9月期日銀短観(大企業製造業DI)	2	23:00	(米)9月ISM製造業景況指数	50.5

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

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	▲0.086	0.001	▲0.064	▲0.116
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.102
2W	-	-	▲0.060	▲0.104
3W	-	-	0.001	▲0.107
1M	-	-	-	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.154
6M	-	-	-	▲0.172
1Y	-	-	-	▲0.187

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、▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.08%~▲0.035%のレンジで取引された。四半期末日にあたることから、資金調達を控える先が多く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.018%の▲0.064%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

本日より比較するとビッドサイドは増加し、出合レンジも上昇すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月30日	10月1日	10月2日
券	+400	+700	+0
財政	▲2,000	▲25,300	▲63,000
過不足	▲1,600	▲24,600	▲63,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	スタート	▲7,800	スタート
共通担保(全店)	▲2,200	+2,200	
CP等買入	▲4,400	+4,000	
国債補完供給	+400	▲1,100	+1,100
当座預金増減	▲2,700	▲15,700	▲63,000
当座預金残高	4,084,100	4,068,400	4,005,400
準備預金残高	3,553,400	主な需給要因	
積み終了先	3,551,600	国債発行(2年)	
超過準備	3,549,200	国債発行(10年)	
非準備先残高	530,700	税・保険揚げ	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	50.0%		
乖離率	49.9%		

9月30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(10/1~)						
1~3年	4,200	13,723	4,204	0.005	0.007	2.6
3~5年	3,400	7,242	3,403	0.001	0.002	76.2
国債補完供給(9/30~10/1)						
		1,043	1,043	▲0.350	▲0.350	
		2	2	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
9月27日時点 5,207,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,085,600
10月1日以降の残り所要積数 4,000
平均 300

国庫短期証券入札予定

来月の国債買入オペ予定

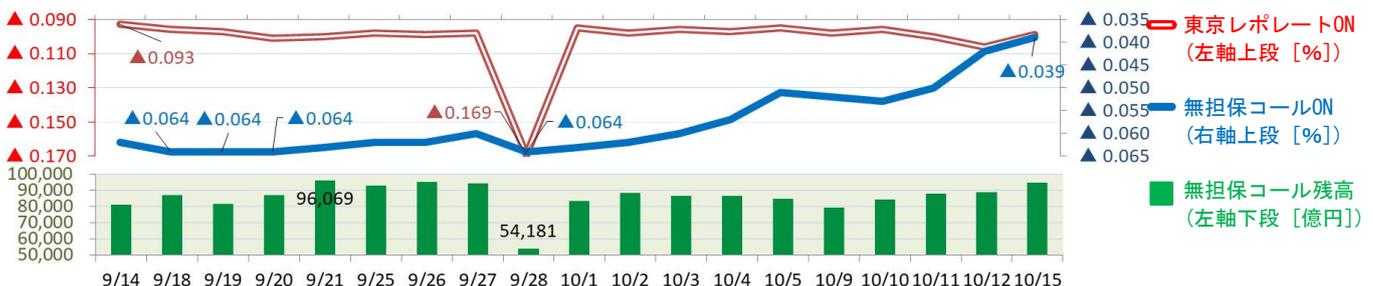
10月4日	3ヶ月	第861回
10月9日	6ヶ月	
10月11日	3ヶ月	
10月17日	1年	
10月1日	10年	
10月10日	30年	
10月17日	5年	
10月24日	20年	

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	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 15 21 28	9月30日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	4 15 21 28	9月26日	4
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300	7 18 30	9月20日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	9月26日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	1

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。