

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月29日	8月30日	8月31日	9月3日
加重平均金利	▲0.053	▲0.050	▲0.055	▲0.052
東京レポレート(ON)	▲0.109	▲0.107	▲0.098	▲0.098
無コール残	86,527	83,988	78,360	84,386
ON	53,107	52,518	47,420	53,206
その他	33,420	31,470	30,940	31,180
有コール残	15,947	14,532	25,221	27,387

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	▲0.054	▲0.098
T/N	-	-	0.000	▲0.104
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	0.001	▲0.017	▲0.108
2W	▲0.035	▲0.010	▲0.029	▲0.110
3W	-	-	-	▲0.118
1M	-	-	-	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.010	▲0.137
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.158

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5日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因(9月見込み)	-	10:45	(中)8月財新サービス業PMI
	-	-	18:00	(欧)7月小売売上高[前月比]
	-	-	21:30	(米)7月貿易収支
				-470億米ドル

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、▲0.055%の合出から始まった。その後は主に▲0.075~▲0.025%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▲0.002%の▲0.054%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態を中心にビッドが厚く、本日と同様の堅調な地合となると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月4日	9月5日	9月6日
券		+200	+800
財政		▲26,700	▲8,500
過不足		▲26,500	▲7,700
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+2,500	
国債買入			+9,000
CP等買入		▲400	
社債等買入	▲200	▲200	
国債補完供給	+400	+900	
当座預金増減	▲24,700	+1,600	▲20,000
当座預金残高	3,870,000	3,871,600	3,851,600
準備預金残高	3,384,500	主な需給要因	
積み終了先	3,383,900		
超過準備	3,383,900		
非準備先残高	485,500		
準備預金進捗率	99.9%		国債発行(10年)
平均	64.5%		
乖離率	35.4%		

9月4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
国債買入(9/5~)						
1~3年	3,000	8,731	3,004	0.000	0.001	78.6
3~5年	3,500	9,988	3,503	▲0.001	0.000	16.4
10~25年	1,800	5,966	1,801	0.003	0.004	91.1
25年~	600	2,471	605	0.002	0.003	35.2
CP等買入(9/7~)						
	4,500	10,238	4,483	▲0.007	▲0.004	19.7
国債補完供給(9/4~9/5)						
	48,820	905	905	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース[億円]
9月3日時点 4,989,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,121,300
9月5日以降の残り所要	
積数	3,200
平均	300

国庫短期証券入札予定

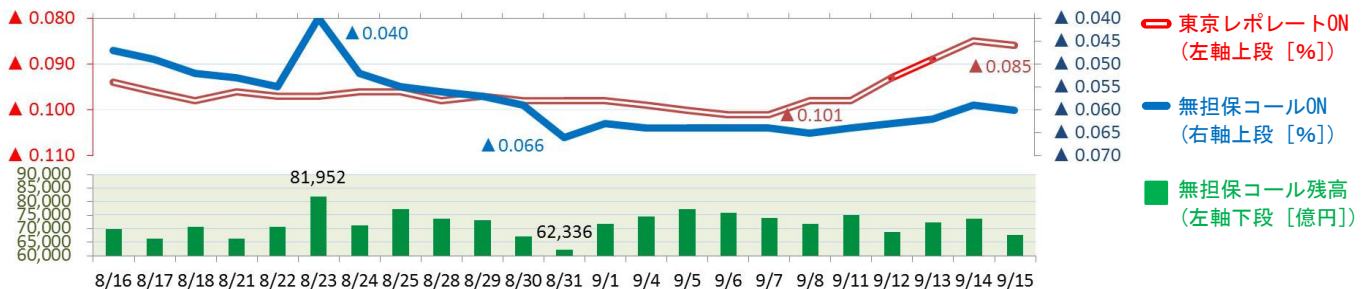
9月6日	6ヶ月	第781回
9月7日	3ヶ月	第782回
9月14日	3ヶ月	
9月18日	1年	
国債入札予定		
9月5日	10年	
9月11日	30年	
9月13日	5年	
9月20日	20年	

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	8月29日	2
1年超3年以下	2,000~4,000 程度	3,000			
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	4 10 14 21 24	9月4日	4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,000	6 10 12 18 25	8月31日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	4 12 18 21 27	9月4日	4
25年超	500~1,500 程度	600			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月22日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	8月17日	-

1年前の市場推移

○2017年8月積み期[8月16日~9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。