

短期市場の推移

	9月3日	9月4日	9月5日	9月6日
加重平均金利	▲0.052	▲0.054	▲0.052	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.098	▲0.098	▲0.098
無コール残	84,386	84,736	87,402	86,082
ON	53,206	53,216	54,922	54,512
その他	31,180	31,520	32,480	31,570
有コール残	27,387	26,044	25,125	25,106

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10日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	4-6月期国内総生産 (GDP)改定値 [前期比年率]	+2.6%	17:30 (英)7月鉱工業生産 指数[前月比]	0.2%
8:50	7月国際収支 (経常収支)	18932億円	アトランタ連銀総裁の講演	
8:50	国際収支状況 (7月速報)	-	-	-

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

	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	▲0.053	▲0.092
T/N	-	-	0.000	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.010	▲0.023	▲0.102
2W	-	-	▲0.033	▲0.108
3W	-	-	-	▲0.137
1M	-	-	-	▲0.136
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.138
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

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▲0.070~▲0.030%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▲0.053%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070		▲0.080 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

週明けも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7日	9月10日	9月10日	9月11日	9月11日	9月11日
券	+600	+400	+400	+1,000	+1,000	
財政	+1,000	▲22,600	▲22,600	+5,000	+5,000	
過不足	+1,600	▲22,200	▲22,200	+6,000	+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
国債買入		+5,500				
共通担保(全店)			▲2,200	+1,400		
CP等買入	▲600	+4,500	▲600			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+400	▲200	+200			
当座預金増減	+11,100	▲23,400		+6,000		
当座預金残高	3,857,400	3,834,000		3,840,000		
準備預金残高	3,381,400	主な需給要因				
積み終了先	3,381,200					
超過準備	3,381,000					
非準備預金残高	476,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	80.6%					
乖離率	19.3%					

9月7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(9/7~9/10)						
	95,636	173	173	▲0.600	▲0.600	
	19,900	6	6	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(9/10~9/25)						
	8,000	1,363	1,363			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月6日時点 4,940,100	今積期の所要準備額 3,098,100
	9月10日以降の残り所要積数 800
	平均 100

国庫短期証券入札予定

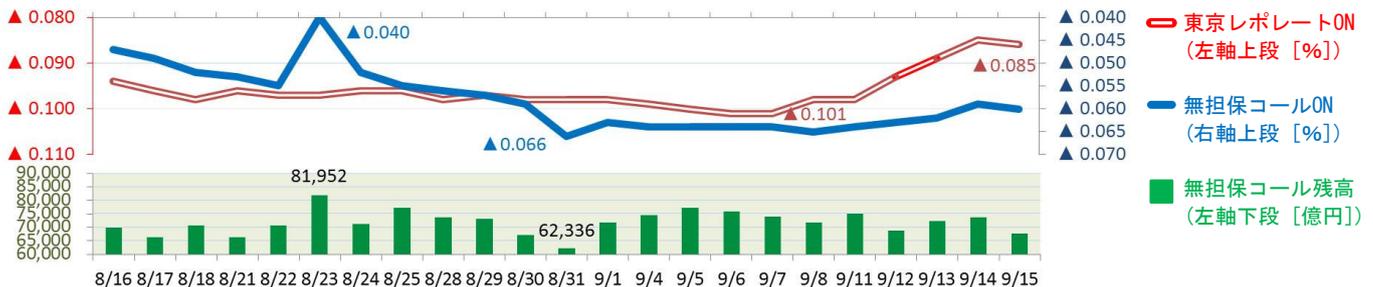
9月14日	3ヶ月	第783回
9月18日	1年	
9月21日	3ヶ月	
9月28日	3ヶ月	
9月11日	30年	
9月13日	5年	
9月20日	20年	
9月26日	40年	

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	2,000~4,000 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	4,500	6	10 12 18 25	9月6日 4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600	4	12 18 21 27	9月4日 4
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		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。