

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月6日	9月7日	9月10日	9月11日
加重平均金利	▲0.051	▲0.053	▲0.054	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.092	▲0.095	▲0.095
無コール残	86,082	88,797	86,434	92,450
ON	54,512	58,327	55,984	61,880
その他	31,570	30,470	30,450	30,570
有コール残	25,106	26,746	25,193	26,338

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	8月国内企業物価指数[前年比]	+3.1%	20:45	(欧)9月欧中銀(ECB)政策金利	0.0%
8:50	7月機械受注[前月比]	+5.7%	21:30	(米)8月消費者物価コア指数[前年比]	2.4%
8:50	企業物価指数(8月)	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

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	▲0.080	0.001	▲0.058	▲0.094
T/N	-	-	0.000	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	0.001	▲0.020	▲0.103
2W	▲0.033	0.001	▲0.027	▲0.110
3W	-	-	0.000	▲0.137
1M	-	-	-	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.135
6M	-	-	-	▲0.146
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

本日の無担保コールON物は、▲0.060%の合出から始まった。その後は主に▲0.080~▲0.030%のレンジで取引された。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
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.075 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

積み期最終日の前日となるが、本日と同様に大きく取り上がる動きまでは至らず、本日は横ばい圏で推移すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月12日	9月13日	9月12日	9月13日	9月14日	9月15日
券		+600		▲800		▲1,000
財政		▲9,800		+2,300		▲11,000
過不足		▲9,200		+1,500		▲12,000
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				+7,400		
CP等買入	▲400		▲200			+5,000
社債等買入			▲100			
ETF買入	+200					▲25,900
国債補完供給	▲100		+100			
貸出増加支援						
当座預金増減		▲9,500		+8,700		▲32,900
当座預金残高		3,842,900		3,851,600		3,818,700
準備預金残高		3,377,000				
積み終了先		3,376,900				
超過準備		3,376,900				
非準備預金残高		465,900				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		90.3%				
乖離率		9.6%				

9月12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(9/13~)						
5~10年	4,500	10,383	4,510	0.005	0.006	27.9
10~25年	1,800	5,422	1,810	0.004	0.005	13.5
25年~	600	1,621	606	0.005	0.006	57.5
国債補完供給(9/12~9/13)						
10,000	85	85	▲0.600	▲0.600		
10,000	5	5	▲0.600	▲0.600		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月11日時点 4,944,800	今積期の所要準備額 3,098,100
	9月13日以降の残り所要積数 500
	平均 200

国庫短期証券入札予定

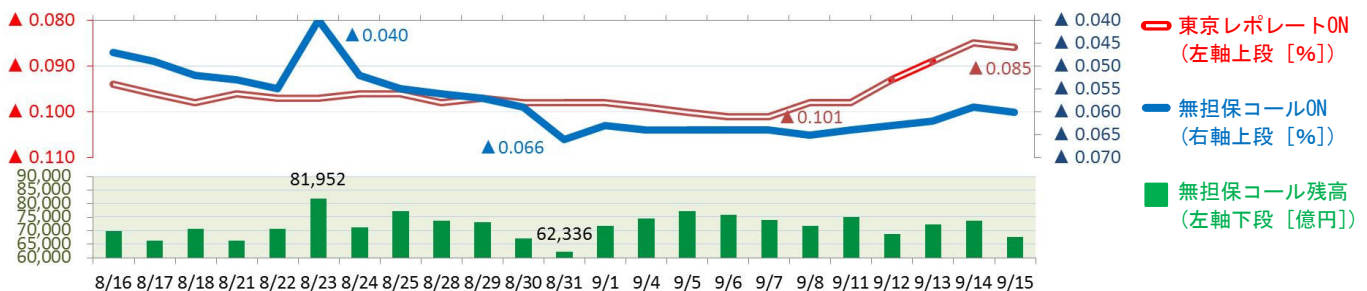
今月の国債買入オペ予定

9月14日	3ヶ月	第783回
9月18日	1年	第784回
9月21日	3ヶ月	
9月28日	3ヶ月	
9月13日	5年	
9月20日	20年	
9月26日	40年	
9月28日	2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10日	3
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	6 10 12 18 25	9月12日	2
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12日	3
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。