

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月7日	9月10日	9月11日	9月12日
加重平均金利	▲0.053	▲0.054	▲0.057	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.092	▲0.095	▲0.095	▲0.094
無コール残	88,797	86,434	92,450	89,293
ON	58,327	55,984	61,880	59,073
その他	30,470	30,450	30,570	30,220
有コール残	26,746	25,193	26,338	26,790

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14日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
13:30	7月の鉱工業生産 確報	-	18:00	(欧)7月貿易収支	-
未定	9月の月例経済報告	-	21:30	(米)8月小売売上高	0.6%
			22:15	(米)8月鉱工業生産 指数[前月比]	0.4%

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	▲0.059	▲0.094
T/N	-	-	0.000	▲0.117
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	0.230	▲0.007	▲0.113
2W	-	-	▲0.030	▲0.116
3W	-	-	-	▲0.137
1M	-	-	-	▲0.134
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、▲0.065%の出合から始まった。その後は主に▲0.080~▲0.030%のレンジで取引されたが、調達一巡後はビッドが薄くなり▲0.086%の出合も見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.001%の▲0.059%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.070	▲0.086 ~ ▲0.065	▲0.086 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

来積期にもかかる取引となることから、調達サイドの一部は慎重な動きとなることが予想される。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月13日	9月14日	9月13日	9月14日	9月18日
券	▲800	▲700			+1,000
財政	+1,000	▲8,700			+12,000
過不足	+200	▲9,400			+13,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+7,400			
共通担保(全店)					▲1,300
CP等買入	▲200		▲1,300	+5,000	
社債等買入	▲100				
国債補完供給	+100	▲200	+200		
貸出増加支援			▲7,000	+10,700	
当座預金増減	+7,200	▲1,800			+11,700
当座預金残高	3,850,100	3,848,300			3,860,000
準備預金残高	3,383,000				
積み終了先	3,383,000				
超過準備	3,382,600				
非準備預金残高	467,100				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	93.5%				
乖離率	6.5%				

9月13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(9/13~9/14)	102,541	215	215	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月12日時点 4,934,700	今積期の所要準備額 3,098,100
	9月14日以降の残り所要積数 0
	平均 0

国庫短期証券入札予定

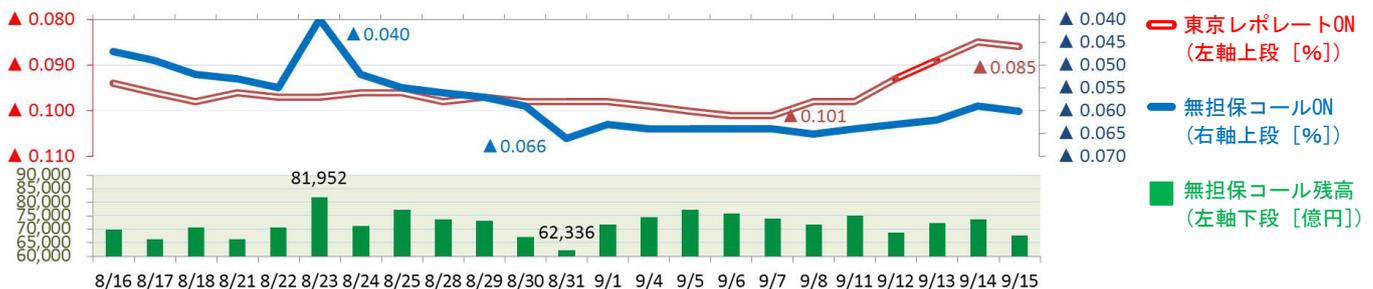
今月の国債買入オペ予定

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20日	20年	
9月26日	40年	
9月28日	2年	
9月5日	10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。