

短期市場の推移

	9月10日	9月11日	9月12日	9月13日
加重平均金利	▲0.054	▲0.057	▲0.058	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.095	▲0.095	▲0.094	▲0.094
無コール残	86,434	92,450	89,293	83,354
ON	55,984	61,880	59,073	53,964
その他	30,450	30,570	30,220	29,390
有コール残	25,193	26,338	26,790	25,984

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18日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
金融政策決定会合(1日目)		-	
-		-	
-		-	

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	▲0.086	0.001	▲0.062	▲0.093
T/N	-	-	0.000	▲0.106
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.112
2W	-	-	-	▲0.132
3W	-	-	-	▲0.132
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

本日の市況

積み最終日となる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▲0.086~▲0.030%のレンジで取引された。
来積期にもかかる取引であることから一部のビッドサイドは慎重な調達姿勢となり、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.004%の▲0.062%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.070	▲0.086 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

積み序盤となる翌営業日は、ビッドサイドが慎重な調達姿勢となることが想定されるため、軟調な地合が予想される。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月14日		9月18日		9月19日
券	▲600		+1,100		+0
財政	▲9,700		+11,200		+4,000
過不足	▲10,300		+12,300		+4,000
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				+7,100	
共通担保(全店)			▲1,300	+1,900	
CP等買入	▲1,300	+5,000	▲900		
社債等買入			▲200		
国債補完供給	+200	▲300	+300		
貸出増加支援	▲7,000	+10,700			
当座預金増減	▲3,000		+19,200		+4,000
当座預金残高	3,847,100		3,866,300		3,870,300
準備預金残高	3,396,200		3,396,200		
積み終了先	3,396,200		3,396,200		
超過準備	3,396,200		3,396,200		
非準備先残高	450,900		450,900		
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		
平均	100.0%		100.0%		
乖離率	0.0%		0.0%		

9月14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(9/18~)						
~1年	500	1,396	500	0.159	0.165	96.8
1~3年	3,000	9,332	3,012	0.002	0.003	53.9
3~5年	3,500	13,748	3,508	0.002	0.003	14.6
社債等買入(9/21~)	1,000	2,640	1,000	▲0.044	▲0.018	9.4
国債補完供給(9/14~9/18)						
84,055	207	207	▲0.600	▲0.600		
21,175	6	6	▲0.600	▲0.600		
共通担保(全店)(9/18~10/1)	8,000	1,881	1,881			

マナタリーベース [億円]
9月13日時点 4,942,800

所要 [億円]
来積期の所要準備額 2,987,900
9月18日以降の残り所要積数 115,800
平均 4.100

国庫短期証券入札予定

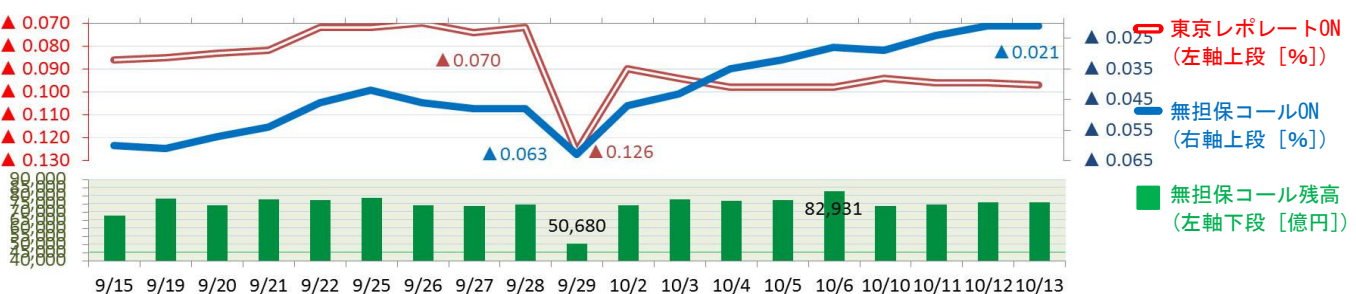
9月14日	3ヶ月	第783回
9月18日	1年	第784回
9月21日	3ヶ月	
9月28日	3ヶ月	
9月20日	20年	
9月26日	40年	
9月28日	2年	
9月5日	10年	

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14日	0
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14日	2
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9月積み期 [9月15日~10月13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。
上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会