

短期市場の推移

[億円][%]

	9月11日	9月12日	9月13日	9月14日
加重平均金利	▲0.057	▲0.058	▲0.058	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.095	▲0.094	▲0.094	▲0.093
無コール残	92,450	89,293	83,354	81,468
ON	61,880	59,073	53,964	52,548
その他	30,570	30,220	29,390	28,920
有コール残	26,338	26,790	25,984	26,264

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19日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
-	政策委員会・金融政策 決定会合の決定内容	-	20:00	(米)MBA住宅ローン 申請指数[前週比]
8:50	8月貿易収支	-	21:30	(米)4-6月期経常収支
14:00頃	実質輸出入の動向	-	21:30	(米)8月住宅着工件数

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	▲0.064	▲0.096
T/N	-	-	0.000	▲0.104
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.111
2W	-	-	▲0.001	▲0.135
3W	-	-	-	▲0.130
1M	-	-	▲0.025	▲0.130
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.156

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

積み初日となる本日の無担保コールON物は、▲0.065%の出合から始まり、その後は▲0.086~▲0.035%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▲0.064%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

本日と同様に、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

[億円]

	日銀速報 9月18日	日銀予想 9月19日	当社需給予想 9月20日
券	+1,000	+300	+0
財政	+11,100	+2,300	+74,000
過不足	+12,100	+2,600	+74,000
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	+7,100	+7,100	-
共通担保(全店)	▲1,300	+1,900	-
CP等買入	▲900	▲500	-
社債等買入	▲200	-	-
国債補完供給	+300 ▲1,000	+1,000	-
当座預金増減	+18,000	+10,200	+74,000
当座預金残高	3,865,100	3,875,300	3,949,300
準備預金残高	3,388,800	主な需給要因	
積み終了先	3,352,400	国庫短期証券 発行・償還(1Y)	
超過準備	3,339,500	国債償還(5年・ 10年・20年・変 動15年)	
非準備先残高	476,300	マナターリーベース [億円]	
準備預金進捗率	97.8%	9月14日時点 4,940,500	
平均	10.0%	所要	
乖離率	87.8%	今積期の所要準備額 2,987,900	
		9月19日以降の残り所要 積数 66,500 平均 2,500	

9月18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(9/19~)						
5~10年	4,500	11,282	4,506	0.006	0.007	42.2
10~25年	1,800	5,831	1,807	0.007	0.007	99.1
25年~	600	2,462	604	0.008	0.008	100.0
米ドル資金供給(9/20~9/27)						
	0	0	2,410	2,410		
国債補完供給(9/18~9/19)						
	76,505	503	503	▲0.600	▲0.600	
	69,581	454	454	▲0.600	▲0.600	

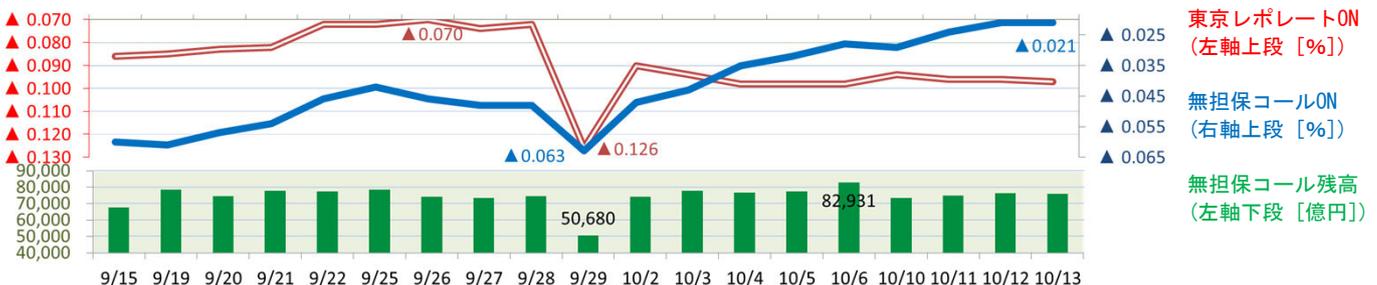
国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

9月21日	3ヶ月	第785回	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
9月28日	3ヶ月		1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	9月14日	0
10月5日	3ヶ月		1年超3年以下	2,000~4,000 程度	3,000			
10月9日	6ヶ月		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
9月20日	20年		5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	6 10 12 18 25	9月18日	1
9月26日	40年		10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
9月28日	2年		25年超	500~1,500 程度	600	4 12 18 21 27	9月18日	2
10月2日	10年		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。