

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月12日	9月13日	9月14日	9月18日
加重平均金利	▲0.058	▲0.058	▲0.062	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.094	▲0.094	▲0.093	▲0.096
無コール残	89,293	83,354	81,468	87,033
ON	59,073	53,964	52,548	55,843
その他	30,220	29,390	28,920	31,190
有コール残	26,790	25,984	26,264	26,473

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。

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	▲0.085	0.001	▲0.064	▲0.097
T/N	-	-	0.000	▲0.109
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.036	▲0.028	▲0.033	▲0.111
2W	-	-	-	▲0.132
3W	-	-	0.040	▲0.128
1M	-	-	-	▲0.128
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

9月20日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	資金循環統計(速報) (4~6月期)	-	21:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分]
-	【記者会見】黒田総裁 (9月19日分)	-	23:00	(米)8月景気先行指数
-	-	-	23:00	(米)8月中古住宅 販売件数

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.065%の引出から始まった。
その後は▲0.085~▲0.035%の水準で取引された。
同加重平均金利(速報)は、前営業日対比横ばいの▲0.064%となった。
本日結果が公表された日銀決定会合では政策の現状維持が決定された。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

大量償還日となるものの、地合いに与える影響は限定的と予想する。このため、出合の水準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19日	9月20日	9月21日
券	+300	▲1,000	▲1,000
財政	+0	+72,800	▲8,000
過不足	+300	+71,800	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲500	▲300	▲1,000
CP等買入	-	▲500	-
社債等買入	-	-	+1,000
ETF買入	-	+700	-
被災地金融機関支援	-	-	▲800
国債補完供給	+1,000	+900	+800
当座預金増減	+7,000	+72,600	▲8,000
当座預金残高	3,872,100	3,944,700	3,936,700
準備預金残高	3,394,000	主な需給要因	
積み終了先	3,373,300	国庫短期証券	
超過準備	3,368,000	発行・償還(1Y)	
非準備先残高	478,100	国債償還	
準備預金進捗率	98.6%	(5年・10年・20年・変動15年)	国債発行(20年)
平均	13.3%		
乖離率	85.3%		

9月19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	按分
国債補完供給(9/19~9/20)						
	47,614	479	479	▲0.600	▲0.600	
	39,707	441	441	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円] 所要 [億円]

9月18日時点	4,957,400	今積期の所要準備額	2,987,900
		9月20日以降の残り所要	
		積数	40,500
		平均	1,600

国庫短期証券入札予定

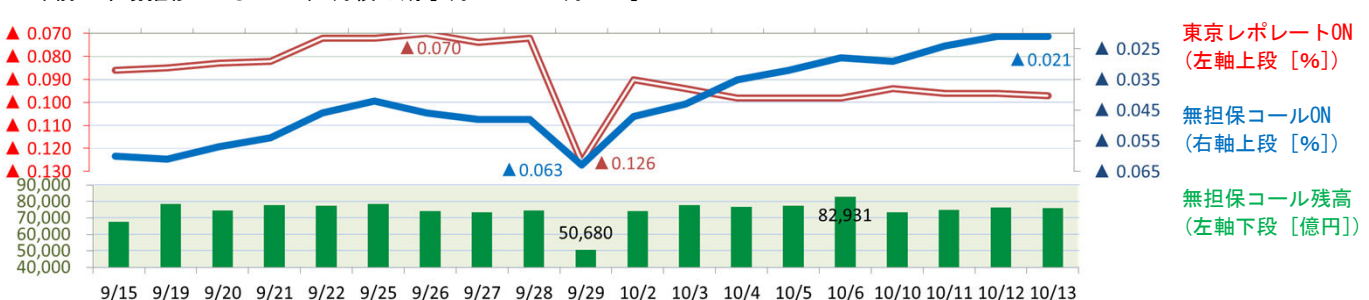
9月21日	3ヶ月	第785回
9月28日	3ヶ月	
10月5日	3ヶ月	
10月9日	6ヶ月	
国債入札予定		
9月20日	20年	
9月26日	40年	
9月28日	2年	
10月2日	10年	

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	4 10 14 21 24	9月14日	2
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	6 10 12 18 25	9月18日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	4 12 18 21 27	9月18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			
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。