

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月14日	9月18日	9月19日	9月20日
加重平均金利	▲0.062	▲0.064	▲0.064	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.096	▲0.097	▲0.101
無コール残	81,468	87,033	81,913	86,960
ON	52,548	55,843	50,773	51,540
その他	28,920	31,190	31,140	35,420
有コール残	26,264	26,473	20,104	25,301

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	▲0.150	0.001	▲0.063	▲0.100
T/N	-	-	0.000	▲0.112
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.038	▲0.025	▲0.031	▲0.130
2W	▲0.020	▲0.005	▲0.017	▲0.126
3W	-	-	-	▲0.126
1M	-	-	-	▲0.127
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲0.132
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.154

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25日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	8月の企業向けサービス価格		(米)FOMC(26日まで)	
8:50	7/30、31日の日銀決定会合議事要旨		(米)9月の消費者信頼感指数	
	黒田日銀総裁の会見			

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、▲0.070%の出合から始まった。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+0.001%の▲0.063%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	▲0.080 ~ ▲0.073	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.086 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

ビッドは厚いものの、大きく取り上がる動きまでは至らず、本日対比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21日	9月25日	9月26日
券	▲700	+300	+0
財政	▲900	+4,600	▲4,000
過不足	▲1,600	+4,900	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	▲5,000		
国債買入		+8,700	
共通担保(全店)		+2,100	
CP等買入	▲900	▲700	
社債等買入		+1,000	
ETF買入		+300	
被災地金融機関支援	▲800	+800	
国債補完供給	+1,000	+1,600	
当座預金増減	+3,200	+15,400	▲4,000
当座預金残高	3,946,000	3,961,400	3,957,400
準備預金残高	3,456,000	主な需給要因	
積み終了先	3,453,500		
超過準備	3,452,600		
非準備先残高	490,000		
準備預金進捗率	99.5%	国庫短期証券	
平均	30.0%	発行・償還(3M)	
乖離率	69.5%		

9月21日のオペ結果 [円][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
国債買入(9/25~)						
1~3年	3,000	8,082	3,003	0.001	0.003	23.8
3~5年	3,500	8,533	3,506	0.003	0.004	35.0
10~25年	1,800	5,690	1,802	0.021	0.025	15.7
25年~	500	2,208	502	0.038	0.040	80.5
国債補完供給(9/21~9/25)						
108,230	1,486	1,486	▲0.600	▲0.600		
共通担保(全店)(9/25~10/9)						
8,000	2,142	2,142				

マネタリーベース [億円]
9月20日時点 5,035,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 2,987,900
9月25日以降の残り所要
積数 13,900
平均 700

国庫短期証券入札予定

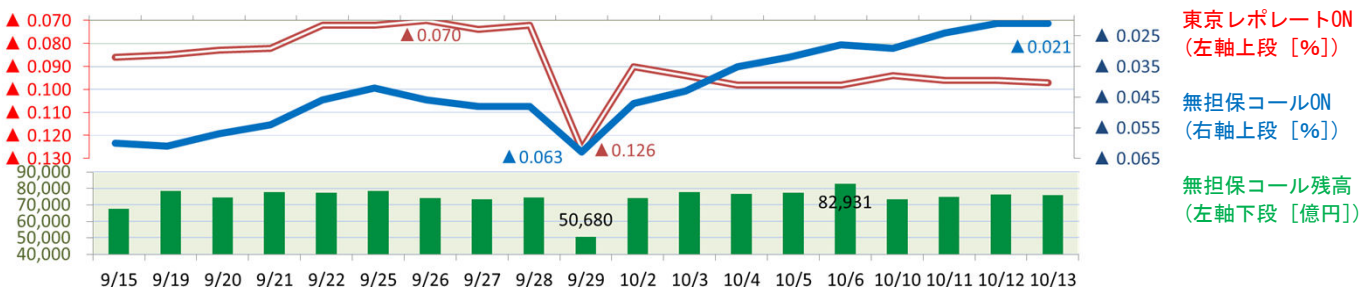
9月28日 3ヶ月 第786回
10月5日 3ヶ月
10月9日 6ヶ月
10月12日 3ヶ月
国債入札予定
9月26日 40年
9月28日 2年
10月2日 10年
10月11日 30年

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		9月21日	0
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	4 10 14 21 24	9月18日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	6 10 12 18 25	9月21日	1
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	4 12 18 21 27	9月6日	1
25年超	500~1,500 程度	500		8月17日	-
物価連動債	250 程度	250	月2回程度		
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

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。