

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月20日	9月21日	9月25日	9月26日
加重平均金利	▲0.064	▲0.063	▲0.062	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.100	▲0.098	▲0.099
無コール残	86,960	96,069	93,236	95,124
ON	51,540	59,339	55,476	57,254
その他	35,420	36,730	37,760	37,870
有コール残	25,301	23,339	21,686	23,088

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28日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:30	8月有効求人倍率	1.63倍	23:00	9月シカゴ大消費者信頼感確報	100.4
8:50	金融政策決定会合における主な意見(9月18・19日分)	-		NY連銀総裁の講演	
8:50	8月鉱工業生産指数[前月比]	+1.5%		リッチモンド連銀総裁の講演	

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	▲0.060	▲0.098
T/N	-	-	-	▲0.143
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.036	▲0.035	▲0.035	▲0.127
2W	▲0.030	▲0.005	▲0.023	▲0.123
3W	-	-	-	▲0.122
1M	-	-	-	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.132
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.155

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

本日の無担保コールON物は、▲0.07%の出合から始まった。その後は主に▲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+0.002%の▲0.06%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

四半期末となるため、調達を控える先が出る見込み。本日対比で地合は弱含むと予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月27日	9月28日	10月1日
券	▲900	▲600	+1,000
財政	▲11,000	+2,200	▲22,000
過不足	▲11,900	+1,600	▲21,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+9,200
共通担保(全店)			▲1,900
CP等買入	▲1,200	▲4,800	+5,000
ETF買入	+100	+1,000	
国債補完供給	+2,500	+1,800	
当座預金増減	▲12,300	+13,800	▲22,900
当座預金残高	3,947,900	3,961,700	3,938,800
準備預金残高	3,462,800	主な需給要因	
積み終了先	3,462,000		
超過準備	3,462,000		
非準備預金残高	485,100		
準備預金進捗率	99.7%	国庫短期証券発行・償還(3M)	
平均	40.0%	国債発行(2年)	
乖離率	59.7%		

9月27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(9/28~)						
1~3年	3,000	8,156	3,008	▲0.003	▲0.002	98.0
3~5年	3,500	8,442	3,502	▲0.005	▲0.004	74.2
10~25年	1,800	4,840	1,811	▲0.010	▲0.009	97.6
25年~	500	1,710	501	▲0.011	▲0.010	89.2
国債補完供給(9/27~9/28)						
	72,894	1,123	1,123	▲0.600	▲0.600	
	48,330	604	604	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月26日時点 5,053,800	今積期の所要準備額 2,988,300
	9月28日以降の残り所要積数 9,000
	平均 500

国庫短期証券入札予定

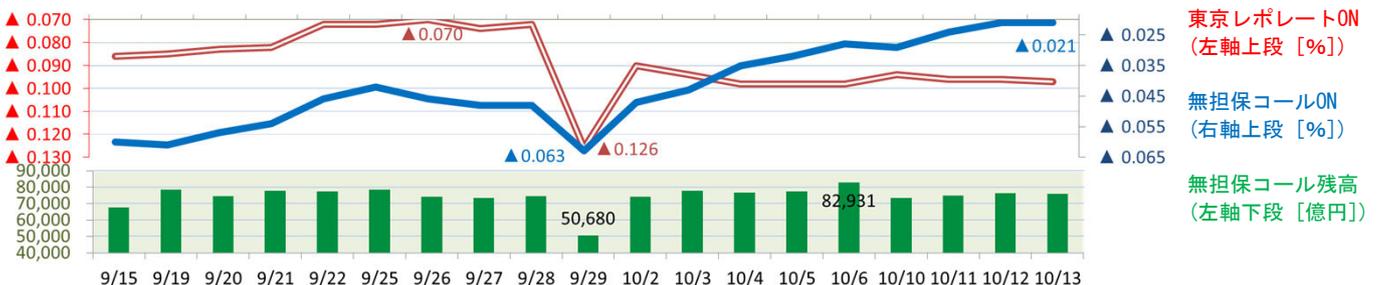
9月28日	3ヶ月	第786回
10月5日	3ヶ月	
10月9日	6ヶ月	
10月12日	3ヶ月	
国債入札予定		
9月28日	2年	
10月2日	10年	
10月11日	30年	
10月16日	5年	

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27日	0
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	6 10/12 18 25	9月25日	0
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	500	4 12/18 21 27	9月27日	0
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	9月25日	0
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。