

短期市場の推移

	9月21日	9月25日	9月26日	9月27日
加重平均金利	▲0.063	▲0.062	▲0.062	▲0.060
東京レポレート(ON)	▲0.100	▲0.098	▲0.099	▲0.098
無コール残	96,069	93,236	95,124	94,437
ON	59,339	55,476	57,254	56,762
その他	36,730	37,760	37,870	37,675
有コール残	23,339	21,686	23,088	28,592

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。

10月1日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	短観(9月概要)	-	(米)9月ISM製造業景況指数	-
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(9月実績)	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.169
T/N	-	-	-	▲0.114
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.112
2W	-	-	▲0.030	▲0.114
3W	-	-	-	▲0.119
1M	▲0.035	0.010	▲0.009	▲0.126
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.140
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

四半期末となる本日の無担保コールON物は、▲0.075%の割合から始まった。その後は、資金調達を控える先が多く出合の水準も昨日より低下した。同加重平均は前営業日対比▲0.004%の▲0.064%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	- ~ -	▲0.086 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

本日と比較するとビットサイドは増加するが、大きく取りあがる展開にはならないと予想する。取引のレンジは▲0.086%~▲0.035%で取引されると予想

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月28日	10月1日	10月1日	10月2日	10月2日	10月2日
券	▲600	+1,000	▲1,000	+0	▲8,000	+0
財政	▲800	▲29,300	▲28,300	▲8,000	▲8,000	▲8,000
過不足	▲1,400	▲28,300	▲28,300	▲8,000	▲8,000	▲8,000
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		+9,200				
共通担保(全店)			▲1,900	+1,900		
CP等買入	▲4,800	+5,000	▲100			
ETF買入		+1,000				
国債補完供給	+1,800	▲2,900	+2,900			
当座預金増減		+7,900	▲25,500	▲8,000		
当座預金残高	3,955,800	3,930,300	3,922,300			
準備預金残高	3,469,000					
積み終了先	3,468,100					
超過準備	3,467,100					
非準備先残高	486,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	50.0%					
乖離率	49.9%					

9月28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
国債補完供給(9/28~10/1)	122,490	2,776	2,776	▲0.600	▲0.600	
	48,311	62	62	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(10/1~10/15)	8,000	1,891	1,891			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月27日時点 5,042,400	今積期の所要準備額 2,992,200
	10月1日以降の残り所要積数 3,300
	平均 200

国庫短期証券入札予定

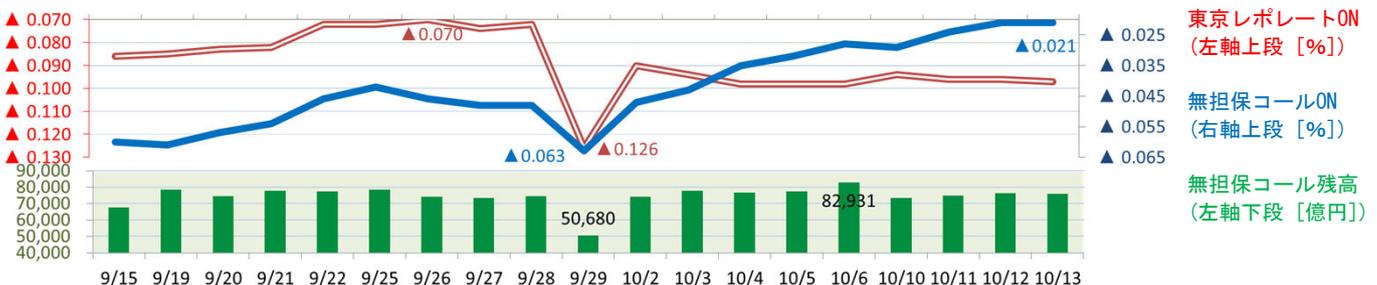
10月5日	3ヶ月	第78/回
10月9日	6ヶ月	
10月12日	3ヶ月	
10月18日	1年	
10月2日	10年	
10月11日	30年	
10月16日	5年	
10月18日	20年	

来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	2
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	3 12 17 26 30	9月27日	5
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	3 10 17 24 26	9月25日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	500	5 12 19 24 30	9月27日	5
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	9月25日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	8月17日	1

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。