



### 短期市場の推移

	8月30日	9月2日	9月3日	9月4日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.230	0.233	0.237	0.237
無コール残	81,634	77,956	77,759	75,165
ON	39,047	35,809	35,612	32,618
その他	42,587	42,147	42,147	42,547
有コール残	37,018	37,819	39,485	38,130

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	0.213	0.228	0.227	0.246
T/N	-	-	-	0.239
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.193
2W	-	-	-	0.193
3W	-	-	-	0.192
1M	-	-	0.325	0.192
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.201
6M	-	-	-	0.253
1Y	-	-	-	0.318

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6日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	7月の景気動向指数速報		(米) 8月の雇用統計	
15:00	8月のコール市場残高		(欧) 4~6月GDP	
	-		-	

### 本日の市況

無担保コールON物は0.228%の出合から始まり、その後は主に0.225%~0.228%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.225 ~ 0.228

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月5日	9月6日	9月5日	9月6日	9月5日	9月6日
券	+200		+300		+1,000	
財政	+2,200		▲6,800		+9,000	
過不足		+2,400		▲6,500		+10,000
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		+8,700				
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+16,100	▲15,800	+15,800			
当座預金増減		+11,200		+9,100		+10,000
当座預金残高		5,434,500		5,443,600		5,453,600
準備預金残高		4,868,300	主な需給要因			
積み終了先		4,868,200	国債発行(30年)	国庫短期証券発行償還(3M)		
超過準備		4,868,200				
非準備先残高		566,200				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		67.7%				
乖離率		32.2%				

### 9月5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(9/5~9/6)	16,154	16,154	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]  
9月4日時点 6,666,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,070,500
9月6日以降の残り所要	
積数	500
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

9月6日	3ヶ月(第1254回)
9月9日	6ヶ月(第1255回)
9月13日	3ヶ月
9月18日	1年

### 国債入札予定

9月10日	5年
9月12日	20年
9月26日	40年
9月30日	2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	1500	1,500	4	9月4日	0
1年超3年以下	3500	3,500	4 11 18 25	9月4日	3
3年超5年以下	3750	3,750	4 11 18 25	9月4日	3
5年超10年以下	4000	4,000	6 11 18 25	8月28日	4
10年超25年以下	1500	1,500	6 18 25	8月28日	3
25年超	750	750	6 11	8月28日	2
物価連動債	600	600	25	8月28日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会