

### 短期市場の推移

	8月29日	8月30日	9月2日	9月3日
加重平均金利	▲0.050	▲0.061	▲0.063	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.086	▲0.085	▲0.089	▲0.089
無コール残	98,505	83,938	90,120	87,330
ON	62,200	53,393	58,380	55,780
その他	36,305	30,545	31,740	31,550
有コール残	18,648	21,043	19,892	22,780

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	【記者会見】片岡審議委員 (9月4日)	21:15	(米)8月ADP 全米雇用報告 14.3万人
-	-	21:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分] -
-	-	23:00	(米)8月ISM非製造業 景況指数 54.1

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	▲0.080	0.001	▲0.067	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.008	▲0.039	▲0.092
2W	▲0.040	▲0.010	▲0.021	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.102
1M	-	-	-	▲0.122
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.136
6M	-	-	-	▲0.160
1Y	-	-	-	▲0.169

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、▲0.065%の合出から始まった。その後は、主に▲0.080%~▲0.050%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日と横ばいの▲0.067%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.050

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの慎重な調達姿勢は継続し、地合いは横ばいと予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月4日	9月5日	9月5日	9月6日	9月6日	9月7日
券		+700		+0		+1,000
財政		▲42,000		+200		▲7,000
過不足		▲41,300		+200		▲6,000
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
国庫短期証券買入		+2,500				
CP等買入			▲600			
社債等買入	▲100					
ETF買入				+500		
国債補完供給		▲400	+400			
当座預金増減		▲39,300	+500			▲6,000
当座預金残高		3,965,900	3,966,400			3,960,400
準備預金残高		3,461,800	主な需給要因			
積み終了先		3,461,500				
超過準備		3,461,500				
非準備先残高		504,100				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		64.5%				
乖離率		35.4%				

### 9月4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
米ドル資金供給(9/6~9/12)		0	0	2,630	2,630	
国債補完供給(9/4~9/5)		402	402	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
 9月3日時点 5,127,200

所要 [億円]  
 今積期の所要準備額 3,179,800  
 9月5日以降の残り所要積数 2,100  
 平均 200

### 国庫短期証券入札予定

9月6日	3ヶ月	第855回
9月9日	6ヶ月	第856回
9月13日	3ヶ月	
9月18日	1年	
9月5日	30年	
9月11日	5年	
9月18日	20年	
9月25日	40年	

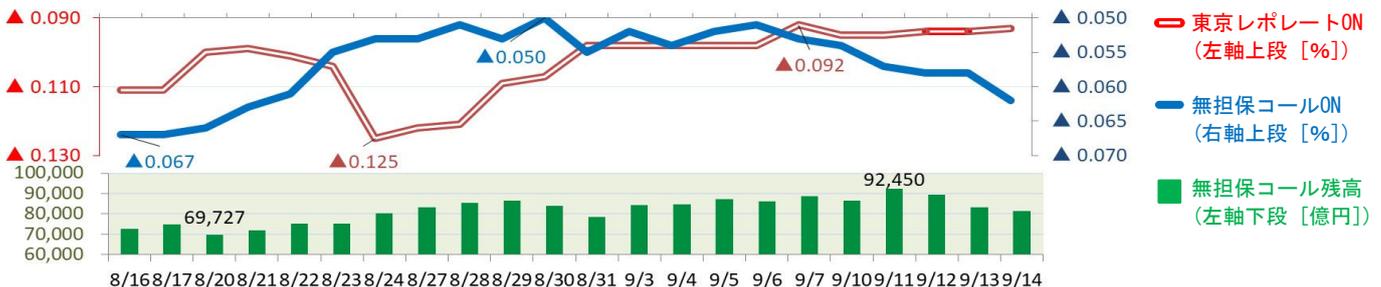
### 今月の国債買入オペ予定

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	8月30日	2
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	4,000		8月30日	4
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	6 17 24 30	8月30日	4
5年超10年以下	2,500~5,500 程度	4,000	6 12 20 26	8月30日	4
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,400		9月2日	2
25年超	100~1,000 程度	400	2 12 20		
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月26日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	-

### 1年前の市場推移

○2018年8月積み期 [8月16日~9月14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。