



### 短期市場の推移

	8月30日	8月31日	9月1日	9月2日
加重平均金利	▲0.036	▲0.036	▲0.032	▲0.026
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.086	▲0.080	▲0.075
無コール残	132,980	123,375	123,757	122,614
ON	68,812	61,517	61,069	60,391
その他	64,168	61,858	62,688	62,223
有コール残	16,656	18,122	18,721	18,652

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.070	0.001	▲0.020	▲0.073
T/N	-	-	-	▲0.075
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.000	▲0.014	▲0.080
2W	-	-	-	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.090
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.130

無担保コール(速報)は日銀、東京レボ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
-	-	(米)休場 (レーバデー)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%の水準で出合が見られた。昨日同様に都銀・地銀業態を中心に調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.020%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.030 ~ ▲0.010

### 翌営業日のマーケット

調達ニーズがやや弱まり、出合水準は本日対比で横ばいか若干の低下を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月3日	9月6日	9月3日	9月6日	9月7日	9月7日
券	+600	+800	+600	+800	+1,000	+1,000
財政	▲37,700	+12,200	▲37,700	+12,200	+2,000	+2,000
過不足	▲37,100	+13,000	▲37,100	+13,000	+3,000	+3,000
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				+10,700		
CP等買入			▲200			
社債等買入	▲100		▲100			
当座預金増減	▲37,200	+23,400	▲37,200	+23,400	+3,000	+3,000
当座預金残高	5,300,900	5,324,300	5,300,900	5,324,300	5,327,300	5,327,300
準備預金残高	4,672,000		4,672,000			
積み終了先	4,672,000		4,672,000			
超過準備	4,672,000		4,672,000			
非準備先残高	628,900		628,900			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	67.7%		67.7%			
乖離率	32.2%		32.2%			

### 9月3日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(9/6~)						
1~3年	4,500	11,702	4,509	0.003	0.004	98.8
3~5年	4,500	11,946	4,504	0.000	0.001	82.5
10~25年	1,500	3,132	1,510	0.005	0.006	54.2
国債補充供給(9/3~9/6)						
	22	22	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース 【億円】  
 9月2日時点 6,558,600

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,739,200
9月6日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

9月9日	6ヶ月 第1021回
9月10日	3ヶ月 第1022回
9月16日	1年
9月17日	3ヶ月
9月7日	30年
9月9日	5年
9月16日	20年
9月28日	40年

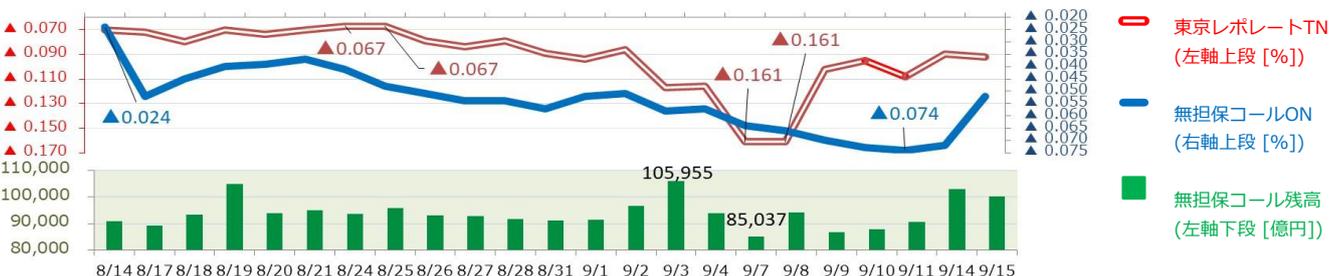
### 今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	8月30日	1
1年超3年以下	4500	4,500	3 8 15 24	9月3日	3
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 24 29	9月3日	3
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 24 29	8月30日	4
10年超25年以下	1500	1,500	3 24	9月3日	0
25年超	500	500		8月25日	1
物価連動債	600	600	月1回	8月12日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月7日	-

### 1年前の市場推移

○2020年8月積み期 [8月14日~9月15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。 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