



短期市場の推移

	2月4日	2月7日	2月8日	2月9日
加重平均金利	▲0.018	▲0.020	▲0.020	▲0.020
東京レポレート(TN)	▲0.082	▲0.082	▲0.082	▲0.081
無コール残	175,764	171,550	175,373	171,822
ON	103,093	102,009	107,242	103,611
その他	72,671	69,541	68,131	68,211
有コール残	29,701	29,145	28,944	28,968

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	▲0.080	0.001	▲0.022	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.001	0.050	0.016	▲0.084
2W	▲0.010	▲0.005	▲0.008	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.090
1M	-	-	0.130	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.123

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

2月14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	欧	ラガルドECB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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.01%の出合から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.010%のレンジで推移した。週末4日積みの影響は限定的であり、出合の水準に大きな変化はなく本日の同加重平均金利(速報)は前営業日比若干低下の▲0.022%(速報)となった。本日、日本銀行は2月14日に指値オペを実施することを発表した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.038	▲0.030 ~ ▲0.018	▲0.035 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

積みめの着地に向けて調達を控える先も見られ、出会い水準は若干の低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月10日	2月14日	2月14日	2月15日	2月15日	2月15日
券	▲100	+800	+800	+0	+0	+0
財政	+6,900	▲23,400	▲23,400	+102,000	+102,000	+102,000
過不足	+6,800	▲22,600	▲22,600	+102,000	+102,000	+102,000
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		+13,200				
CP等買入	▲700	▲600	▲600			
国債補完供給	+200	▲400	+400			
当座預金増減	+19,100	▲22,800	▲22,800	+102,000	+102,000	+102,000
当座預金残高	5,286,200	5,263,400	5,263,400	5,365,400	5,365,400	5,365,400
準備預金残高	4,695,800	4,695,700	4,695,700	4,695,700	4,695,700	4,695,700
積み終了先		4,695,700	4,695,700	4,695,700	4,695,700	4,695,700
超過準備	4,695,700	4,695,700	4,695,700	4,695,700	4,695,700	4,695,700
非準備先残高	590,400	590,400	590,400	590,400	590,400	590,400
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均乖離率	93.5%	93.5%	93.5%	93.5%	93.5%	93.5%
乖離率	6.5%	6.5%	6.5%	6.5%	6.5%	6.5%

2月10日のオペ結果

CP等買入(2/16~) 5,000 6,716 4,996 ▲0.030 ▲0.014 26.7

国債補完供給(2/10~2/14) 292 292 ▲0.350 ▲0.350

74 74 ▲0.350 ▲0.350

マナタリーベース (億円) 2月9日時点 6,505,500

所要 今積期の所要準備額 3,777,100

2月14日以降の残り所要 積数 0

平均 0

国庫短期証券入札予定

2月17日	1年(第1059回)
2月18日	3ヶ月(第1060回)
2月24日	6ヶ月
2月25日	3ヶ月
2月15日	5年
2月17日	20年
2月25日	2年
2月1日	10年

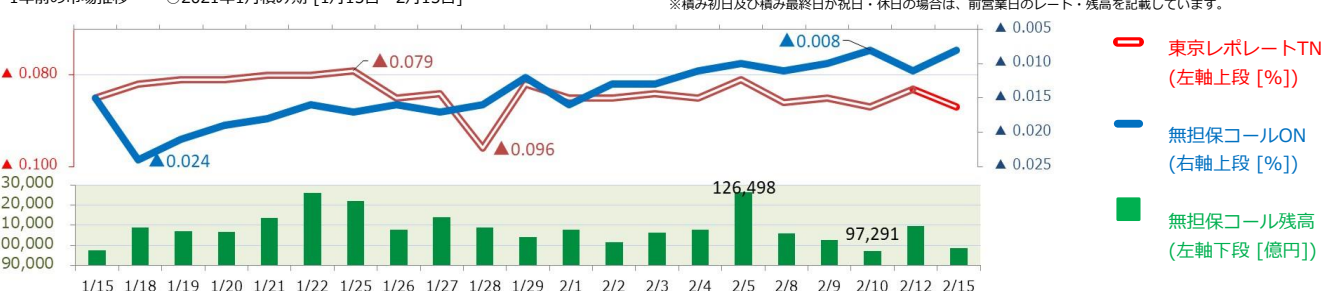
今月の国債買入オペ予定

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	2月2日	0
1年超3年以下	4500	4,500	2 9 16 21	2月9日	2
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 21 24	2月9日	2
5年超10年以下	4250	4,250	9 16 21 24	2月9日	3
10年超25年以下	1500	1,500	2 9 16 21 24	2月2日	0
25年超	500	500	16	1月17日	1
物価連動債	600	600	月1回	1月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月20日	-

1年前の市場推移

○2021年1月積み期 [1月15日~2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