



短期市場の推移

	2月7日	2月8日	2月9日	2月10日
加重平均金利	▲0.020	▲0.020	▲0.020	▲0.022
東京レボレート(TN)	▲0.082	▲0.082	▲0.081	▲0.082
無コール残	171,550	175,373	171,822	180,499
ON	102,009	107,242	103,611	114,228
その他	69,541	68,131	68,211	66,271
有コール残	29,145	28,944	28,968	29,307

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	▲0.080	0.001	▲0.019	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.010	▲0.005	▲0.008	▲0.085
2W	▲0.039	▲0.003	▲0.033	▲0.086
3W	▲0.010	0.150	0.004	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.124

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

2月15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10-12月期国内総生産(GDP)速報値[前期比年率]	+6.0%	22:30	(米)1月生産者物価コア指数[前年比]	-
	-			-	
	-			-	

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▲0.040%~▲0.010%のレンジで推移した。一部オファーサイドで放出ニーズがなくなる先もあり、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日比+0.003%の▲0.019%(速報)となった。また本日、日本銀行により2018年7月以来の指値オペが実施された。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.040 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

1月積み期最終日の明日は、調整による調達ニーズが高まると思われ、出合の水準は本対比上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月14日		2月15日		2月16日
券	+800		+900		+0
財政	▲26,400		+108,400		▲7,000
過不足	▲25,600		+109,300		▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)					▲2,800
CP等買入	▲600		▲300		+5,000
国債補完供給	+400	▲500	+500		
当座預金増減	▲26,300		+109,500		▲4,800
当座預金残高	5,259,900		5,369,400		5,364,600
準備預金残高	4,667,200		4,667,200		4,667,200
積み終了先	4,667,200		源泉税揚げ		国債発行(5年)
超過準備	4,667,200		年金定時払い		国債発行償還(個人)
非準備先残高	592,700		国債発行償還(個人)		
準備預金進捗率	100.0%				
平均	96.8%				
乖離率	3.2%				

2月14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(2/14~2/15)	492	492	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリベース (億円)
2月10日時点 6,524,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,777,100
2月15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

国債入札予定

2月15日	5年
2月17日	20年
2月25日	2年
3月1日	10年

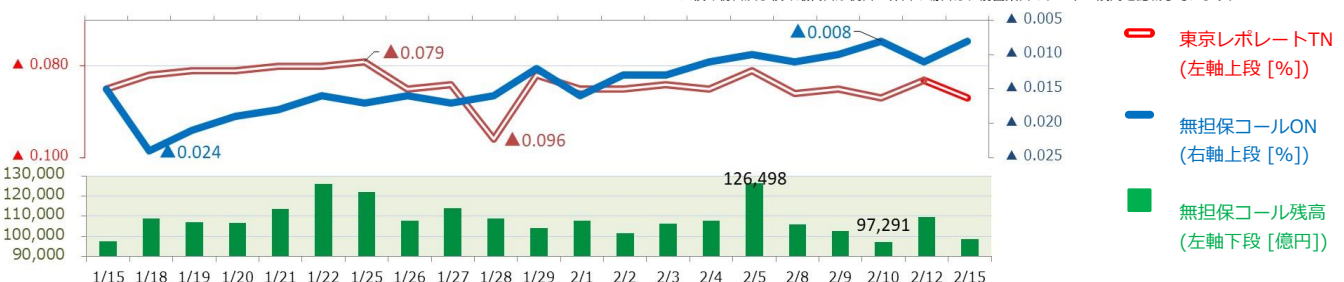
今月の国債買入オペ予定

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 16	2月2日	0
25年超	500	500		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