



短期市場の推移

[億円] [%]

	2月9日	2月10日	2月14日	2月15日
加重平均金利	▲0.020	▲0.022	▲0.019	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.081	▲0.082	▲0.082	▲0.086
無コール残	171,822	180,499	135,720	139,432
ON	103,611	114,228	74,851	74,851
その他	68,211	66,271	60,869	64,581
有コール残	28,968	29,307	29,717	29,679

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	▲0.024	▲0.084
T/N	-	-	▲0.008	▲0.087
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.010	0.001	▲0.009	▲0.086
2W	▲0.050	▲0.001	▲0.036	▲0.087
3W	-	-	0.000	▲0.090
1M	▲0.010	▲0.003	▲0.009	▲0.093
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

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月16日	2月17日	2月18日
券	▲100	▲900	▲1,000
財政	+13,200	+1,600	▲6,000
過不足	+13,100	+700	▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+5,000	▲9,400	スタート
国債買入			
共通担保(全店)	▲2,800	+2,600	
CP等買入	▲500	+5,000	▲500
E T F 買入			+100
国債補完供給	+200	▲200	+200
当座預金増減	+22,400	+9,900	▲7,000
当座預金残高	5,388,800	5,398,700	5,391,700
準備預金残高	4,727,200	主な需給要因	
積み終了先	3,587,300	国債発行(20年)	
超過準備	1,577,400		
非準備先残高	661,600		
準備預金進捗率	92.5%		
平均	3.6%		
乖離率	88.9%		

2月16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
国債買入(2/17~)						
1~3年	4,500	13,355	4,508	0.005	0.006	41.8
5~10年	4,250	8,361	4,256	0.002	0.005	65.5
25年~	500	2,539	506	0.027	0.027	52.2
国債補完供給(2/16~2/17)						
	166	166	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
2月15日時点 6,603,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,404,800
2月17日以降の残り所要	
積数	255,000
平均	9,400

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17日	20年
2月25日	2年
2月1日	10年
2月3日	30年

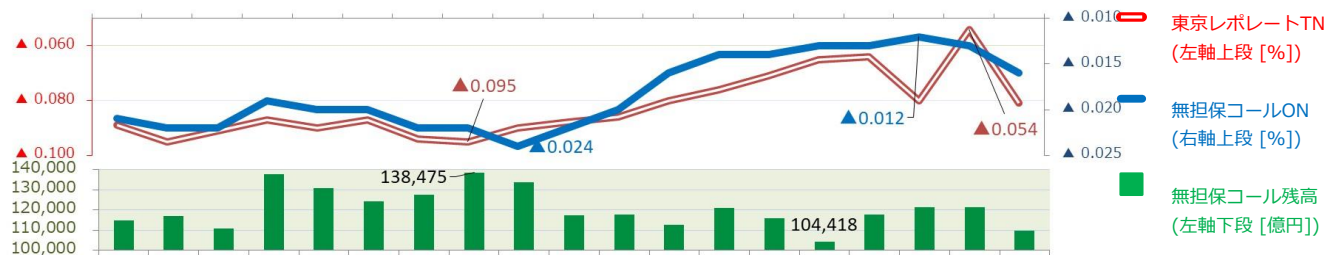
今月の国債買入オペ予定

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16日	1
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16日	2
10年超25年以下	1500	1,500	2 16	2月2日	0
25年超	500	500	16	2月16日	0
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	0

1年前の市場推移

○2021年2月積み期 [2月16日~3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