



短期市場の推移

	2月10日	2月14日	2月15日	2月16日
加重平均金利	▲0.022	▲0.019	▲0.010	▲0.024
東京レポレート(TN)	▲0.082	▲0.082	▲0.086	▲0.087
無コール残	180,499	135,720	139,432	164,906
ON	114,228	74,851	74,851	98,245
その他	66,271	60,869	64,581	66,661
有コール残	29,307	29,717	29,679	28,928

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	0.150	▲0.022	▲0.086
T/N	▲0.008	▲0.005	▲0.007	▲0.086
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.010	0.050	0.006	▲0.086
2W	▲0.035	▲0.001	▲0.029	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.090
1M	-	-	▲0.002	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.110
1Y	-	-	-	▲0.119

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月17日	2月18日	2月18日	2月21日	2月21日	2月21日
券	▲900	▲400				+0
財政	+3,100	+400				▲41,000
過不足		+2,200		+0		▲41,000
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		+9,400				
CP等買入	▲500		▲400			
E T F 買入		+100				
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減		+11,300	▲300			▲41,000
当座預金残高		5,400,100	5,399,800			5,358,800
準備預金残高		4,734,100				
積み終了先		4,728,300				
超過準備		4,489,500				
非準備先残高		666,000				
準備預金進捗率		99.7%				
平均		7.1%				
乖離率		92.6%				

[億円]

2月17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
社債等買入(2/22~)	750	1,639	751	0.233	0.272	11.8
国債補完供給(2/17~2/18)	147	147	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
 2月16日時点 6,625,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,404,800
2月18日以降の残り所要	
積数	10,400
平均	400

国庫短期証券入札予定

2月18日	3ヶ月(第1060回)
2月24日	6ヶ月(第1061回)
2月25日	3ヶ月
3月4日	3ヶ月

国債入札予定

2月25日	2年
3月1日	10年
3月3日	30年
3月8日	5年

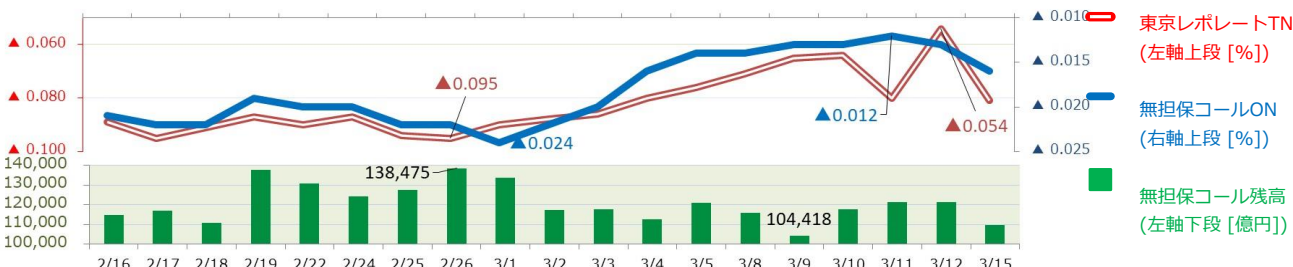
今月の国債買入オペ予定

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	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