



短期市場の推移

	2月14日	2月15日	2月16日	2月17日
加重平均金利	▲0.019	▲0.010	▲0.024	▲0.022
東京レポレート(TN)	▲0.082	▲0.086	▲0.087	▲0.086
無コール残	135,720	139,432	164,906	163,866
ON	74,851	74,851	98,245	95,945
その他	60,869	64,581	66,661	67,921
有コール残	29,717	29,679	28,928	28,971

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	▲0.018	▲0.086
T/N	-	-	▲0.008	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.012	0.250	0.016	▲0.085
2W	-	-	▲0.010	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.089
1M	▲0.015	▲0.005	▲0.010	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.098
6M	-	-	-	▲0.108
1Y	-	-	-	▲0.118

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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)休場(ワシントン大統領誕生記念)	-
-	-	18:00 (欧)2月製造業購買担当者指数(PMI)	58.6
-	-	18:30 (英)2月製造業購買担当者指数(PMI)	57.0

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▲0.015%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.008%のレンジで推移した。週末3日積みのため、ベッドサイドの調達ニーズは強く、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.018%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因の剥落により、合出の水準は本日対比で低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月18日		2月21日		2月22日	
券	▲600		▲200		▲1,000	
財政	+1,900		▲47,100		+1,000	
過不足	+1,300		▲47,300		+0	
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
CP等買入	▲400		▲300			
社債等買入						+800
国債補完供給	+100					
当座預金増減	+1,000		▲47,600		+800	
当座預金残高	5,401,100		5,353,500		5,354,300	
準備預金残高	4,744,200		主な需給要因			
積み終了先	4,743,700		国庫短期証券発行・償還(3M・1Y)			
超過準備	4,742,200					
非準備先残高	656,900					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	17.9%					
乖離率	82.0%					

2月18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(2/18~2/21)	35	35	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
2月17日時点 6,637,900

所要	今積期の所要準備額
2月21日以降の残り所要	3,404,800
積数	4,200
平均	200

国庫短期証券入札予定

2月24日	6ヶ月(第1061回)
2月25日	3ヶ月(第1062回)
3月4日	3ヶ月
3月9日	6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