



短期市場の推移

[億円] [%]

	2月18日	2月21日	2月22日	2月24日
加重平均金利	▲0.018	▲0.019	▲0.017	▲0.017
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.086	▲0.089	▲0.087
無コール残	178,830	169,167	190,442	192,038
ON	108,099	96,026	109,261	114,307
その他	70,731	73,141	81,181	77,731
有コール残	29,308	28,770	28,507	28,181

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	▲0.013	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.089
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.005	▲0.001	▲0.005	▲0.088
2W	-	-	▲0.001	▲0.089
3W	-	-	▲0.005	▲0.089
1M	▲0.015	▲0.005	▲0.010	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.180	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.105
1Y	-	-	-	▲0.114

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25日	2月28日	3月1日
券	▲600	▲200	+0
財政	+14,200	▲5,000	▲15,000
過不足	+13,600	▲5,200	▲15,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+9,400	▲5,400	+5,000
CP等買入	▲800	▲300	-
社債等買入	▲400	-	-
E T F 買入	+600	-	-
国債補完供給	+200	+400	-
新型コロナ対応金融支援特別	-	▲195,800	+205,000
当座預金増減	+22,200	+3,700	▲15,000
当座預金残高	5,395,800	5,399,500	5,384,500
準備預金残高	4,744,800	主な需給要因	
積み終了先	4,744,500	国庫短期証券発行・償還 (3M)	国債発行・償還 (2年)
超過準備	4,744,500	-	-
非準備先残高	651,000	-	-
準備預金進捗率	99.9%	-	-
平均	42.9%	-	-
乖離率	57.0%	-	-

2月25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(2/25~2/28)	422	422	▲0.350	▲0.350	-	-
新型コロナ対応金融支援特別(2/28~8/31)	204,990	204,990	-	-	-	-

マネタリーベース [億円]
2月24日時点 6,615,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,404,800
2月28日以降の残り所要	-
積数	1,400
平均	100

国庫短期証券入札予定

3月4日	3ヶ月
3月9日	6ヶ月
3月11日	3ヶ月
3月16日	1年
3月1日	10年
3月3日	30年
3月8日	5年
3月10日	20年

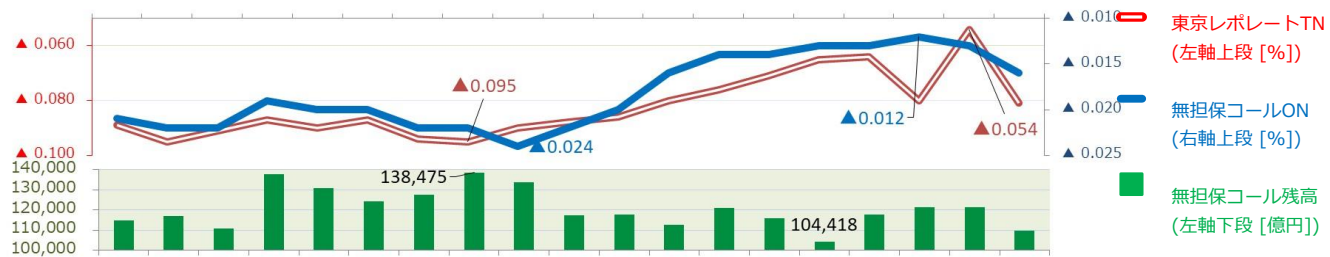
今月の国債買入オペ予定

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21日	0
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 21 24	2月24日	0
5年超10年以下	4250	4,250	9 16 21 24	2月24日	0
10年超25年以下	1500	1,500	2 16	2月2日	0
25年超	500	500	-	2月16日	0
物価連動債	600	600	月1回	2月24日	0
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(登金)第 243号 加入協会 日本証券業協会