



短期市場の推移

	2月21日	2月22日	2月24日	2月25日
加重平均金利	▲0.019	▲0.017	▲0.017	▲0.013
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.089	▲0.087	▲0.089
無コール残	169,167	190,442	192,038	171,982
ON	96,026	109,261	114,307	74,661
その他	73,141	81,181	77,731	97,321
有コール残	28,770	28,507	28,181	28,233

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	▲0.012	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.003	▲0.087
2W	▲0.035	▲0.030	▲0.033	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.089
1M	▲0.008	0.005	▲0.004	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.105
1Y	-	-	-	▲0.114

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

3月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	米	バイデン大統領の一般教書演説
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.008%の割合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.003%のレンジで推移した。先週に引き続き地合に大きな変化はなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日比+0.001%の▲0.012%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.045 ~ ▲0.015	▲0.040 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

引き続き出合の水準は本日対比横ばい圏での推移を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月28日	3月1日	2月28日	3月1日	3月2日
券	▲300	▲400	▲300	▲400	+0
財政	▲7,300	▲34,100	▲7,300	▲34,100	▲75,000
過不足	▲7,600	▲34,500	▲7,600	▲34,500	▲75,000
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)					▲2,600
CP等買入	▲5,400	+5,000	▲200	▲200	
社債等買入	▲300		▲100	▲100	
国債補充供給	+400				
成長基盤強化支援					▲4,000
新型コロナ対応金融支援特別	▲195,800	+205,000			+7,900
当座預金増減	+1,300	▲34,800	+1,300	▲34,800	▲73,700
当座預金残高	5,397,100	5,362,300	5,397,100	5,362,300	5,288,600
準備預金残高	4,732,600		4,732,600		
積み終了先	4,732,200		4,732,200		
超過準備	4,732,200		4,732,200		
非準備先残高	664,500		664,500		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		
平均	46.4%		46.4%		
乖離率	53.5%		53.5%		

2月28日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(2/28~3/1)	27	27	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
2月25日時点 6,637,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,404,800
3月1日以降の残り所要	
積数	1,100
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

来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	1
1年超3年以下	4500	4,500	2 9 16 23	2月21日	4
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 23 30	2月24日	4
5年超10年以下	4250	4,250	9 16 23 30	2月24日	4
10年超25年以下	1500	1,500	2	2月2日	1
25年超	500	500	16	2月16日	1
物価連動債	600	600	月1回	2月24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