



短期市場の推移

	2月22日	2月24日	2月25日	2月28日
加重平均金利	▲0.017	▲0.017	▲0.013	▲0.012
東京レポレート(TN)	▲0.089	▲0.087	▲0.089	▲0.087
無コール残	190,442	192,038	171,982	158,482
ON	109,261	114,307	74,661	73,619
その他	81,181	77,731	97,321	84,863
有コール残	28,507	28,181	28,233	26,688

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	▲0.011	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.003	▲0.017	▲0.088
2W	▲0.045	0.100	▲0.032	▲0.088
3W	-	-	▲0.003	▲0.088
1M	-	-	-	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
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2日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	0:00 (米)2月ISM製造業景況指数	58.0
-	-	22:15 (米)2月ADP全米雇用報告	31.0万人
-	-	-	-

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.003%のレンジで推移した。オファー・ビッドともに大きな動きなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日比+0.001%の▲0.011%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.005	▲0.040 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏での推移を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	3月1日		3月2日		3月3日
券	▲400		▲300		+0
財政	▲31,400		▲77,200		+0
過不足	▲31,800		▲77,500		+0
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+5,000	
共通担保(全店)			▲2,600	+2,600	
CP等買入	▲200				
社債等買入	▲100		▲100		
国債補充供給		▲300	+300		
成長基盤強化支援			▲3,400	+7,900	
当座預金増減	▲32,400		▲67,800		+0
当座預金残高	5,364,700		5,296,900		5,296,900
準備預金残高	4,693,900		主な需給要因		
積み終了先	4,693,500		国債発行(10年)		
超過準備	4,693,500		税保険揚げ		
非準備先残高	670,800				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	50.0%				
乖離率	49.9%				

3月1日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(3/2~)	5,000	20,342	5,002	0.000	0.002	58.1
米ドル資金供給(3/3~3/10)	2	2	0.350	0.350		
国債補充供給(3/1~3/2)	284	284	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(3/2~3/16)	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(3/2~3/11)	20,000	2,601	2,601			
	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース (億円)
2月28日時点 6,639,400

所要	今積期の所要準備額
3月2日以降の残り所要	3,404,800
積数	700
平均	100

国庫短期証券入札予定

3月4日	3ヶ月(第1063回)
3月9日	6ヶ月
3月11日	3ヶ月
3月16日	1年

国債入札予定

3月3日	30年
3月8日	5年
3月10日	20年
3月29日	40年

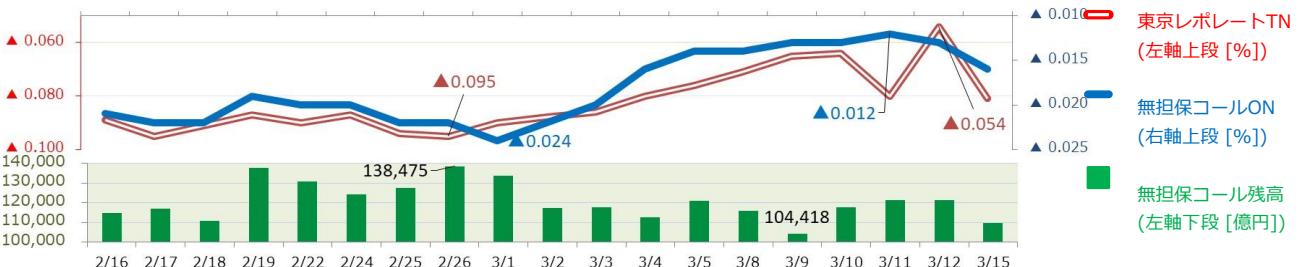
今月の国債買入オペ予定

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	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