



デイリーシグナル

2021年2月1日(月)

短期市場の推移

	1月26日	1月27日	1月28日	1月29日
加重平均金利	▲0.016	▲0.017	▲0.016	▲0.012
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.084	▲0.096	▲0.082
無コール残	107,646	113,824	108,897	104,323
ON	63,258	69,361	64,684	60,740
その他	44,388	44,463	44,213	43,583
有コール残	21,216	21,408	20,773	20,372

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	▲0.055	0.001	▲0.016	▲0.082
T/N	▲0.009	▲0.001	▲0.003	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.030	0.003	▲0.086
2W	▲0.018	0.000	▲0.006	▲0.086
3W	-	-	0.010	▲0.090
1M	▲0.015	0.050	0.007	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.109
1Y	-	-	-	▲0.139

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2日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	マネタリーベース (1月)	-	0:00	(米)1月ISM製造業 景況指数	60.0
10:00	営業毎旬報告 (1月31日現在)	-	19:00	(欧)10-12月期域内総生産 (GDP)速報値[前年比]	-6.1%

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.005%の水準で合出が見られた。先週末に比べ調達ニーズはやや落ち着き、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.013 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、出合いの水準は横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月1日	2月2日	2月2日	2月3日	2月3日
券	+600	+700	+700	+1,000	+1,000
財政	▲26,700	▲18,200	▲18,200	▲85,000	▲85,000
過不足	▲26,100	▲17,500	▲17,500	▲84,000	▲84,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+8,900			
CP等買入	▲100				
国債補完供給	+100	▲100	+100		
当座預金増減	▲17,300	▲17,400	▲17,400	▲84,000	▲84,000
当座預金残高	4,941,700	4,924,300	4,924,300	4,840,300	4,840,300
準備預金残高	4,366,400	主な需給要因			
積み終了先	4,366,400	法人税・消費税・			
超過準備	4,366,400	保険揚げ			
非準備先残高	575,300	国債発行(10年)			
準備預金進捗率	99.9%				
平均	54.8%				
乖離率	45.1%				

2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
国債補完供給(2/1~2/2)	142	142	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
 1月29日時点 6,165,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,604,600
2月2日以降の残り所要	
積数	300
平均	0

国庫短期証券入札予定

2月5日	3ヶ月 第970回
2月9日	6ヶ月
2月12日	3ヶ月
2月18日	1年
2月2日	10年
2月4日	30年
2月8日	物価連動
2月16日	5年

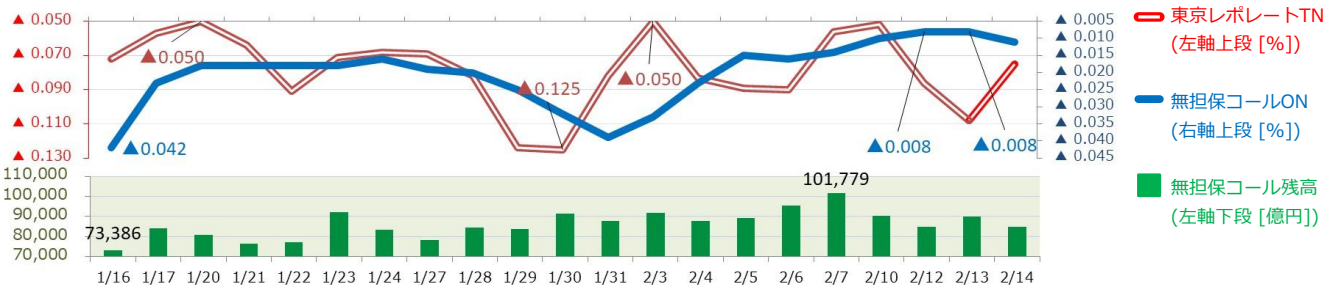
今月の国債買入オペ予定

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	500~1,500	1,000	月2回程度	1月25日	2
1年超3年以下	2,500~5,500	4,500	3 9 15 19 25	1月27日	5
3年超5年以下	2,000~5,500	4,200	3 9 15 19 25	1月29日	5
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 15 19 25	1月29日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	5 22	1月27日	2
25年超	0~500	300	9 22	1月29日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	1月27日	2
変動利付債<偶数日>	500	500	月1回	12月7日	1

1年前の市場推移

○2020年1月積み期 [1月16日~2月14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