



デイリーシグナル

2025年2月10日(月)

	2月4日	2月5日	2月6日	2月7日
加重平均金利	0.477	0.479	0.479	0.477
東京レポレート(TN)	0.448	0.449	0.410	0.445
無コール残	82,790	84,229	86,088	83,028
ON	36,861	36,810	38,099	35,649
その他	45,929	47,419	47,989	47,379
有コール残	39,420	39,571	38,637	38,702

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	0.450	0.525	0.477	0.467
T/N	-	-	-	0.457
S/N	-	-	-	-
1W	0.483	0.550	0.539	0.436
2W	-	-	0.660	0.435
3W	-	-	-	0.435
1M	-	-	0.620	0.434
2M	-	-	0.580	-
3M	-	-	0.700	0.449
6M	-	-	-	0.480
1Y	-	-	-	0.551

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

日本	予想	海外	予想
		(米) CPI (1月)	
		(米)パウエルFRB議長、議会証言 (下院)	

本日市場
 無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後は主に同水準を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット
 ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月10日	2月12日	2月10日	2月12日	2月10日	2月12日
券	+1,000		+600		+0	
財政	+6,300		▲8,900		▲9,000	
過不足	+7,300		▲8,300		▲9,000	
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
国債買入		+9,200				
国債補充供給	+6,500	▲5,100	+5,100			
当座預金増減	+17,900		▲3,200		▲9,000	
当座預金残高	5,194,600		5,191,400		5,182,400	
準備預金残高	4,685,400		主な需給要因			
積み終了先	4,685,100		国債発行(10年・物連)			
超過準備	4,685,100		源泉税揚げ			
非準備先残高	509,200					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	87.1%					
乖離率	12.8%					

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(2/10~2/12)	5,433	5,433	0.150	0.150		
	0	0				

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
2月7日時点 6,421,700	今積期の所要準備額 4,082,300
	2月12日以降の残り所要
	積数 1,400
	平均 300

2月14日	3ヶ月(第1287回)
2月19日	1年
2月21日	3ヶ月
2月28日	3ヶ月

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	3				2月3日	0
1年超3年以下	3000	3,000	3	7	13	19	2月7日	2
3年超5年以下	3000	3,000	3	7	19	26	2月7日	2
5年超10年以下	3250	3,250	7	13	19	26	2月7日	3
10年超25年以下	1500	1,500	3	13	26		2月3日	2
25年超	750	750	13	19			1月30日	2
物価連動債	500	500	26				1月30日	1
変動利付債	-	300					2023/4/14	-

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