



デイリーシグナル

2021年2月4日(木)

短期市場の推移

	1月29日	2月1日	2月2日	2月3日
加重平均金利	▲0.012	▲0.016	▲0.013	▲0.013
東京レポレート(TN)	▲0.082	▲0.085	▲0.085	▲0.084
無コール残	104,323	107,757	101,612	106,416
ON	60,740	64,434	58,089	61,583
その他	43,583	43,323	43,523	44,833
有コール残	20,372	20,189	20,748	22,881

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	▲0.060	0.001	▲0.011	▲0.081
T/N	▲0.015	▲0.001	▲0.010	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.008	▲0.024	▲0.085
2W	-	-	▲0.015	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.090
1M	▲0.020	▲0.005	▲0.013	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.110
1Y	-	-	-	▲0.138

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5日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベースと日本銀行の取引 (1月)	-	22:30	(米)12月貿易収支 -664億米ドル
15:00	コール市場残高 (1月)	-	22:30	(米)1月非農業部門雇用者数 5.0万人
	-	-	22:30	(米)1月失業率 6.7%

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▲0.009%の割合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.005%の水準で出が見られた。引き続きビッドサイドの都銀・地銀の調達意欲は強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.011%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.030	~ ▲0.020	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週末三日積みの要因から出合いの水準は若干の上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月4日		2月5日		2月8日
券	+200		+700		+1,000
財政	+0		▲7,600		▲3,000
過不足	+200		▲6,900		▲2,000
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	+7,800				
CP等買入			▲200		
社債等買入					+3,000
国債補充供給	▲300		+300		
当座預金増減	+7,700		▲6,800		+1,000
当座預金残高	4,862,000		4,855,200		4,856,200
準備預金残高	4,287,300		主な需給要因		
積み終了先	4,287,300		国債発行 (30年)		
超過準備	4,287,300		国庫短期証券発行・償還 (3M)		
非準備先残高	574,700				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	64.5%				
乖離率	35.4%				

2月4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(2/4~2/5)	274	274	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 2月3日時点 6,058,700

所要	所要
今積期の所要準備額	3,604,600
2月5日以降の残り所要	
積数	200
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 第971回
2月12日	3ヶ月
2月18日	1年
2月8日	物価連動
2月16日	5年
2月18日	20年
2月26日	2年

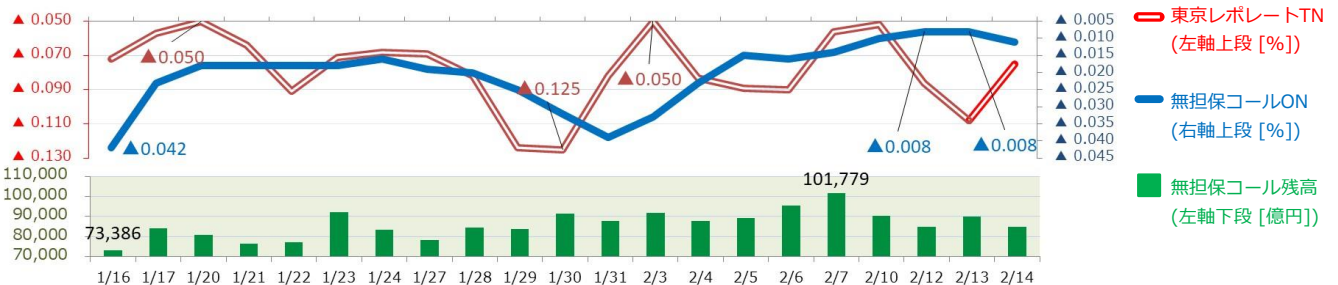
今月の国債買入オペ予定

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	4,000	3 9 15 19 25	2月3日	4
3年超5年以下	2,000~5,500	3,700	3 9 15 19 25	2月3日	4
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こ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