



デイリーシグナル

2021年2月10日(水)

短期市場の推移

	2月4日	2月5日	2月8日	2月9日
加重平均金利	▲0.011	▲0.010	▲0.011	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.081	▲0.086	▲0.085
無コール残	107,886	126,498	105,861	102,598
ON	63,733	68,335	51,478	56,365
その他	44,153	58,163	54,383	46,233
有コール残	21,074	21,047	20,663	21,222

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.050	0.001	▲0.008	▲0.081
T/N	▲0.006	▲0.001	▲0.002	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.088
2W	▲0.014	0.001	▲0.004	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.091
1M	▲0.040	0.013	▲0.016	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.110
1Y	-	-	-	▲0.138

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

2月12日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
【記者会見】中村審議委員 (2月10日)	-	(英)10-12月期 国内総生産 (GDP) [前年比]	-
-	-	(米) 2月ミシガン消費者信頼感 (速報)	-
-	-	-	-

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▲0.010%の出合から始まり、引き続き地銀・大手行の調達意欲は強く、その後は主に▲0.020%~▲0.005%の水準で出合が見られた。なお同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.008%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.008 ~ ▲0.008	▲0.010 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

積み終盤の3日積みということもあり、堅調な地合は継続すると思われる。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月10日		2月12日		2月15日	
券	+0		+300		+1,000	
財政	▲6,700		▲4,300		+55,000	
過不足	▲6,700		▲4,000		+56,000	
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
国庫短期証券買入				+15,000		
国債買入		+12,500				
共通担保(全店)			▲4,000	+3,600		
CP等買入	▲1,100		▲100			+6,000
E T F 買入				+500		
国債補完供給	+500	▲800	+800	+500		
当座預金増減	+4,400		+11,800		+62,000	
当座預金残高	4,861,200		4,873,000		4,935,000	
準備預金残高	4,311,200		主な需給要因			
積み終了先	4,311,200		国庫短期証券 発行・償還 (3M)			
超過準備	4,311,200		年金定時払い・源泉税揚げ			
非準備先残高	550,000					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	87.1%					
乖離率	12.9%					

2月10日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

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(2/12~)	15,000	45,122	15,003	0.003	0.004	61.9
国債補完供給(2/10~2/12)	818	818	▲0.350	▲0.350		
	20	20	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(2/12~2/25)	20,000	3,550	3,550			

マネタリーベース [億円]
2月9日時点 6,060,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,617,200
2月12日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

2月12日	3ヶ月	第972回
2月18日	1年	第973回
2月19日	3ヶ月	
2月24日	6ヶ月	

国債入札予定

2月16日	5年
2月18日	20年
2月26日	2年
3月2日	10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	2月5日	1
1年超3年以下	2,500~5,500	4,000	3 9 15 19 25	2月9日	3
3年超5年以下	2,000~5,500	3,700	3 9 15 19 25	2月9日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 15 19 25	2月9日	3
10年超25年以下	500~2,000	1,200	5 22	2月5日	1
25年超	0~500	300	9 22	2月9日	1
物価運動債	300	300	月2回程度	1月27日	2
変動利付債<偶数月>	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ありません。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