



デイリーシグナル

2022年2月2日(水)

短期市場の推移

	1月27日	1月28日	1月31日	2月1日
加重平均金利	▲0.021	▲0.021	▲0.021	▲0.020
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.086	▲0.086
無コール残	182,713	184,397	153,825	170,015
ON	101,780	105,104	81,872	98,404
その他	80,933	79,293	71,953	71,611
有コール残	17,736	17,287	17,056	29,477

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	▲0.080	0.010	▲0.020	▲0.084
T/N	-	-	▲0.010	▲0.086
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.010	▲0.005	▲0.009	▲0.087
2W	▲0.010	▲0.002	▲0.007	▲0.087
3W	-	-	▲0.010	▲0.090
1M	▲0.003	▲0.002	▲0.003	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.124

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3日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(欧)2月欧中銀 (ECB) 政策金利	0%
-	-	(欧)ラガルド総裁 (ECB) 会見	-
-	-	-	-

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%のレンジで推移した。出し手取り手ともに大きな動きの変化はなく、本日の同加重平均金利 (速報) は前営業日比横ばいの▲0.020% (速報) となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月2日	2月3日	2月3日	2月4日	2月4日
券		+600	▲300		+0
財政		▲104,400	+1,300		▲8,000
過不足		▲103,800	+1,000		▲8,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国庫短期証券買入		+5,000			
国債買入				+12,100	
共通担保(全店)	▲3,000	+2,800			
CP等買入			▲100		
国債補充供給	+100	▲600	+600		
当座預金増減		▲99,500	+13,600		▲8,000
当座預金残高		5,262,800	5,276,400		5,268,400
準備預金残高		4,671,700			主な需給要因
積み終了先		4,671,600			国債発行 (30年)
超過準備		4,671,400			
非準備先残高		591,100			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		58.1%			
乖離率		41.8%			

2月2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
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(2/3~)	~1年	1~3年	3~5年	10~25年	平均	按分
~1年	1,500	2,802	1,502	▲0.018	▲0.005	7.3
1~3年	4,500	10,247	4,505	▲0.001	0.001	60.4
3~5年	4,500	9,079	4,509	▲0.008	▲0.007	55.0
10~25年	1,500	3,084	1,507	▲0.004	▲0.001	8.1

国債補充供給(2/2~2/3)	2/2	2/3	平均
2/2	625	625	▲0.350
2/3	0	0	▲0.350

マナリーベース	所要
2月1日時点	6,602,600

所要	所要
今積期の所要準備額	3,779,800
2月3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4日	3ヶ月(第1056回)
2月9日	6ヶ月(第1057回)
2月10日	3ヶ月
2月17日	1年
2月3日	30年
2月8日	物価連動
2月15日	5年
2月17日	20年

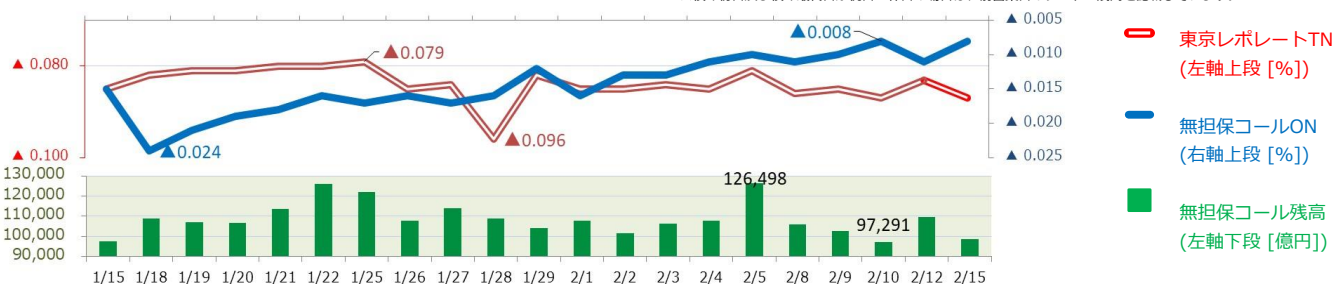
今月の国債買入オペ予定

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	0
1年超3年以下	4500	4,500	2月9日	2月2日	3
3年超5年以下	4500	4,500	2月9日	2月2日	3
5年超10年以下	4250	4,250	2月9日	1月26日	4
10年超25年以下	1500	1,500	2月16日	2月2日	0
25年超	500	500	2月16日	1月17日	1
物価連動債	600	600	月1回	1月26日	-
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1月積み期 [1月15日~2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