



デイリーシグナル

2022年2月8日(火)

短期市場の推移

	[億円] [%]			
	2月2日	2月3日	2月4日	2月7日
加重平均金利	▲0.020	▲0.019	▲0.018	▲0.020
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.084	▲0.082	▲0.082
無コール残	170,690	174,671	175,764	171,550
ON	97,269	99,700	103,093	102,009
その他	73,421	74,971	72,671	69,541
有コール残	29,153	29,015	29,701	29,145

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	▲0.080	0.001	▲0.020	▲0.080
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.001	▲0.083
2W	-	-	0.001	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	0.120	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.123

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9日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本		海外	
	日本	予想	海外	予想
10:30	【挨拶】 中村審議委員 (山梨)		(米) MBA住宅ローン申請指数	
	-		-	
	-		-	

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▲0.01%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。出合の水準に大きな変化はなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日比横ばいの▲0.02% (速報) となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.043	~ ▲0.043	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続き出合の水準は本日対比横ばい圏での推移を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月8日		2月9日		2月10日
券		+300		+200	▲500
財政		▲5,800		+2,500	+4,000
過不足		▲5,500		+2,700	+3,500
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+5,000	
CP等買入	▲100				
社債等買入				+1,300	
国債補充供給	+100	▲100	+100		
当座預金増減		▲5,600		+9,100	+3,500
当座預金残高		5,261,100		5,270,200	5,273,700
準備預金残高		4,668,600	主な需給要因		
積み終了先		4,668,600	国債発行(物運)	国庫短期証券発行・償還(6M)	
超過準備		4,668,600			
非準備先残高		592,500			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		77.4%			
乖離率		22.5%			

2月8日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(2/9~)	5,000	16,748	5,000	0.007	0.007	
米ドル資金供給(2/10~2/17)	3	3	0.340	0.340		
国債補充供給(2/8~2/9)	68	68	▲0.350	▲0.350		
米ドル資金供給用担保国債供給(2/9~2/18)	5,000	2	▲0.100	▲0.100		

マナリーベース [億円]
2月7日時点 6,505,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,777,100
2月9日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

2月9日	6ヶ月(第1057回)
2月10日	3ヶ月(第1058回)
2月17日	1年
2月18日	3ヶ月
2月15日	5年
2月17日	20年
2月25日	2年
2月1日	10年

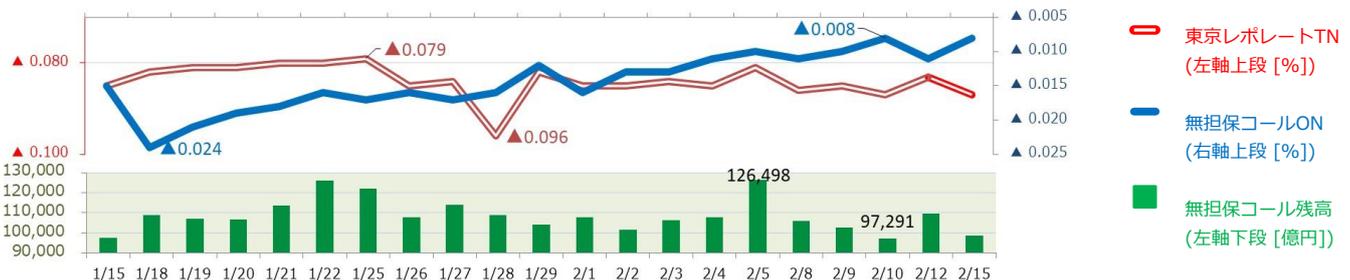
今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	2月2日	0
1年超3年以下	4500	4,500	2 9 16 21	2月2日	3
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 21 24	2月2日	3
5年超10年以下	4250	4,250	9 16 21 24	1月26日	4
10年超25年以下	1500	1,500	2 9 16 21 24	2月2日	0
25年超	500	500	16	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