



デイリーシグナル

2025年2月7日(金)

	2月3日	2月4日	2月5日	2月6日
加重平均金利	0.476	0.477	0.479	0.479
東京レポレート(TN)	0.431	0.448	0.449	0.410
無コール残	81,141	82,790	84,229	86,088
ON	34,152	36,861	36,810	38,099
その他	46,989	45,929	47,419	47,989
有コール残	39,728	39,420	39,571	38,637

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 [%]

日本		海外	
	予想		予想

	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.450	0.525	0.477	0.381
T/N	-	-	-	0.445
S/N	-	-	-	-
1W	0.478	0.650	0.501	0.426
2W	-	-	0.540	0.429
3W	-	-	-	0.431
1M	-	-	-	0.429
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.575	0.448
6M	-	-	-	0.480
1Y	-	-	-	0.551

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。ビッド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▲0.002%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7日		2月10日		2月12日	
券	+900		+900		+1,000	
財政	▲600		+2,000		▲2,000	
過不足	+300		+2,900		▲1,000	
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		
社債等買入	▲200					
国債補完供給	+3,700	▲6,500	+6,500			
当座預金増減	▲2,700		+18,600		▲1,000	
当座預金残高	5,176,700		5,195,300		5,194,300	
準備預金残高	4,664,600		主な需給要因			
積み終了先	4,664,300		国庫短期証券発行償還(3M・6M)			
超過準備	4,664,200					
非準備先残高	512,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	80.6%					
乖離率	19.3%					

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(2/10~)						
1~3年	3,000	9,516	3,002	0.021	0.024	11.0
3~5年	3,000	12,248	3,005	0.032	0.032	68.9
5~10年	3,250	6,464	3,254	0.021	0.023	33.8
国債補完供給(2/7~2/10)						
	6,759	6,759	0.150	0.150		
	0	0				

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
2月6日時点 6,425,400	今積期の所要準備額 4,082,300
	2月10日以降の残り所要
	積数 2,000
	平均 300

入札日	入札期間
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

入札日	物価運動
2月12日	物価運動
2月14日	5年
2月18日	20年
2月27日	2年

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
物価運動債	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