



デイリーシグナル

2024年9月20日(金)

短期市場の推移

	9月13日	9月17日	9月18日	9月19日
加重平均金利	0.227	0.228	0.228	0.227
東京レポレート(TN)	0.243	0.245	0.239	0.234
無コール残	80,391	74,925	74,914	75,147
ON	33,674	32,815	32,684	33,117
その他	46,717	42,110	42,230	42,030
有コール残	40,337	40,500	40,056	40,247

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	0.215	0.227	0.226	0.244	
T/N	-	-	-	0.235	
S/N	-	-	-	-	
1W	0.290	0.295	0.293	0.201	
2W	-	-	-	0.197	
3W	-	-	-	0.198	
1M	-	-	-	0.198	
2M	-	-	-	-	
3M	-	-	0.340	0.204	
6M	-	-	-	0.252	
1Y	-	-	-	0.318	

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

9月24日の予定 (時刻は日本時間)

日本		海外	
	予想		予想
	-		-
	-		-
	-		-

本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に0.225%~0.227%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▲0.001%の0.226%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.225 ~ 0.227

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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月20日		9月24日		9月25日	
券	▲100		+0		+0	
財政	+41,700		+7,900		+1,000	
過不足	+41,600		+7,900		+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
CP等買入	▲600					
社債等買入	▲600		+500			
国債補完供給	+17,400	▲19,400	+19,400			
当座預金増減	+38,900		+27,300		+1,000	
当座預金残高	5,479,900		5,507,200		5,508,200	
準備預金残高	4,944,500		主な需給要因			
積み終了先	4,942,800		国庫短期証券発行償還(3M)		流動性供給	
超過準備	4,939,900					
非準備先残高	535,400					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	26.7%					
乖離率	73.0%					

9月20日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(9/20~9/24)	16,007	16,007	▲0.050	▲0.050		
	3,815	3,815	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース

9月19日時点 6,681,900 [億円]

所要

今積期の所要準備額	3,940,700
9月24日以降の残り所要	
積数	14,500
平均	700

国庫短期証券入札予定

9月27日	3ヶ月(第1259回)
10月4日	3ヶ月
10月9日	6ヶ月
10月11日	3ヶ月

国債入札予定

9月26日	40年
9月30日	2年
10月3日	10年
10月8日	30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	4				9月4日	0
1年超3年以下	3500	3,500	4	11	18	25	9月18日	1
3年超5年以下	3750	3,750	4	11	18	25	9月18日	1
5年超10年以下	4000	4,000	6	11	18	25	9月18日	1
10年超25年以下	1500	1,500	6	18	25		9月18日	1
25年超	750	750	6	11			9月11日	0
物価連動債	600	600	25				8月28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