



デイリーシグナル

2024年10月21日(月)

短期市場の推移

	10月15日	10月16日	10月17日	10月18日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.240	0.239	0.235	0.239
無コール残	74,369	70,714	72,124	75,151
ON	28,889	25,134	25,534	28,981
その他	45,480	45,580	46,590	46,170
有コール残	39,509	39,161	38,474	39,464

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	0.220	0.227	0.227	0.236
T/N	-	-	-	0.236
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.227	0.201
2W	-	-	0.227	0.201
3W	-	-	-	0.201
1M	-	-	-	0.201
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.211
6M	-	-	-	0.266
1Y	-	-	-	0.324

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

10月22日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
14:00	9月の基調的なインフレ率を捕捉するための指標 (日銀)				
	-				
	-				

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0.226%~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)は前営業日対比横ばいの0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.227 ~ 0.227	0.226 ~ 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	
	10月21日	10月22日	10月22日	10月23日	10月23日	10月23日
券	▲400	▲300	▲300	▲300	▲300	+0
財政	+6,500	▲4,000	▲4,000	▲4,000	▲4,000	▲4,000
過不足	+6,100	▲4,300	▲4,300	▲4,000	▲4,000	▲4,000
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		+11,100				
CP等買入	▲200					
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+8,500	▲8,000	+8,000			
当座預金増減	+17,400	+3,700	+3,700	▲4,000	▲4,000	▲4,000
当座預金残高	5,494,500	5,498,200	5,498,200	5,494,200	5,494,200	5,494,200
準備預金残高	4,901,600	主な需給要因				
積み終了先	4,898,900					
超過準備	4,897,700					
非準備先残高	592,900					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	19.4%					
乖離率	80.2%					

10月21日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

オベ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(10/21~10/22)	8,169	8,169	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
10月18日時点 6,717,400

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	4,041,000
10月22日以降の残り所要	
積数	17,400
平均	700

国庫短期証券入札予定

10月25日	3ヶ月(第1265回)
11月1日	3ヶ月
11月7日	6ヶ月
11月8日	3ヶ月

国債入札予定

10月22日	10年クライメート・トランジション
10月24日	20年
10月29日	2年
11月7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	2		0
1年超3年以下	3250	3,250	2 7 11 18		10月2日 0
3年超5年以下	3250	3,250	2 7 18 28		10月18日 0
5年超10年以下	3750	3,750	7 11 18 28		10月18日 1
10年超25年以下	1500	1,500	7 11 28		10月11日 1
25年超	750	750	2 18		10月18日 0
物価連動債	600	600	28		9月25日 1
変動利付債	-	300	-		4月14日 -

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