



## デイリーシグナル

2024年10月22日(火)

### 短期市場の推移

	10月16日	10月17日	10月18日	10月21日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.239	0.235	0.239	0.236
無コール残	70,714	72,124	75,151	72,312
ON	25,134	25,534	28,981	25,372
その他	45,580	46,590	46,170	46,940
有コール残	39,161	38,474	39,464	38,822

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	0.228	0.227	0.229
T/N	-	-	-	0.232
S/N	-	-	-	-
1W	0.231	0.390	0.303	0.204
2W	-	-	-	0.202
3W	-	-	-	0.202
1M	-	-	-	0.203
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.330	0.212
6M	-	-	-	0.274
1Y	-	-	-	0.327

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23日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) ページブック	-
-	-	-	-
-	-	-	-

### 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22日				10月23日				10月24日	
券	▲400				▲300				▲1,000	
財政	▲4,100				▲7,700				▲5,000	
過不足	▲4,500				▲8,000				▲6,000	
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	エンド	スタート	エンド	スタート
CP等買入			▲200							
社債等買入				+500						
国債補完供給	+8,000	▲8,700	+8,700							
当座預金増減	▲5,200				+1,000				▲6,000	
当座預金残高	5,489,300				5,490,300				5,484,300	
準備預金残高	4,901,700				主な需給要因					
積み終了先	4,899,500									
超過準備	4,899,500									
非準備先残高	587,600									
準備預金進捗率	99.6%									
平均	22.6%									
乖離率	77.0%									

### 10月22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
米ドル資金供給(10/24~10/31)	2	2	5,080	5,080		
国債補完供給(10/22~10/23)	8,856	8,856	▲0.050	▲0.050		
米ドル資金供給用担保国債供給(10/23~11/1)	5,000	2	2	0.220	0.220	

マネタリーベース [億円]  
 10月21日時点 6,735,300

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	4,041,000
10月23日以降の残り所要	
積数	15,100
平均	600

### 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24日	20年
10月29日	2年
11月7日	10年
11月11日	物価連動

### 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 28	10月18日 0
3年超5年以下	3250	3,250	2	7 18 28	10月18日 1
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