



デイリーシグナル

2024年10月25日(金)

短期市場の推移

	10月21日	10月22日	10月23日	10月24日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.236	0.232	0.235	0.230
無コール残	72,312	73,067	73,026	73,201
ON	25,372	25,977	25,776	25,801
その他	46,940	47,090	47,250	47,400
有コール残	38,822	38,440	37,693	38,230

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 [%]

10月28日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	-		-	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

	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	0.221	0.228	0.227	0.240
T/N	-	-	-	0.239
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.204
2W	-	-	0.290	0.203
3W	-	-	0.290	0.203
1M	-	-	0.300	0.205
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.320	0.213
6M	-	-	-	0.276
1Y	-	-	-	0.329

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25日	10月28日	10月28日	10月29日	10月29日	10月29日
券	▲500	▲100	▲100	▲100	▲100	+0
財政	+1,700	+3,400	+3,400	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	+1,200	+3,300	+3,300	+3,000	+3,000	+3,000
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	▲400	▲700	▲700	▲700	▲700	▲700
社債等買入	▲700	▲600	▲600	▲600	▲600	▲600
国債補完供給	+6,100	▲6,700	+6,700			
当座預金増減	▲500	+8,700	+8,700	+3,000	+3,000	+3,000
当座預金残高	5,487,500	5,496,200	5,496,200	5,499,200	5,499,200	5,499,200
準備預金残高	4,914,200	主な需給要因				
積み終了先	4,912,900	国庫短期証券発行償還(3M)				
超過準備	4,912,700					
非準備先残高	573,300					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	38.7%					
乖離率	61.1%					

10月25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(10/25~10/28)	6,859	6,859	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース	所要
10月24日時点 6,730,300	今積期の所要準備額 4,041,000
	10月28日以降の残り所要
	積数 7,200
	平均 400

国庫短期証券入札予定

11月1日	3ヶ月(第1266回)
11月7日	6ヶ月
11月8日	3ヶ月
11月15日	3ヶ月

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	-		2023/4/14 -

国債入札予定

10月29日	2年
11月7日	10年
11月11日	物価連動
11月13日	30年

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