



デイリーシグナル

2025年10月10日(金)

短期市場の推移 [億円] [%]

	10月6日	10月7日	10月8日	10月9日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.478
東京レポレート(TN)	0.493	0.492	0.492	0.494
無コール残	86,181	86,827	87,940	89,120
ON	30,913	31,569	32,262	33,512
その他	55,268	55,258	55,678	55,608
有コール残	25,299	24,967	25,966	26,178

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) パウエルFRB議長 の講演	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	0.450	0.479	0.477	0.495
T/N	-	-	-	0.498
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.470	0.487
2W	0.471	0.523	0.480	0.485
3W	-	-	-	0.488
1M	-	-	-	0.494
2M	-	-	-	-
3M	0.610	0.620	0.613	0.556
6M	-	-	-	0.613
1Y	-	-	-	0.717

本日の市況
 無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%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
 出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月10日		10月14日		10月15日	
券	+200		+0		+0	
財政	▲22,600		▲10,200		+73,000	
過不足	▲22,400		▲10,200		+73,000	
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
共通担保(全店)	▲100		▲100		▲8,000	
社債等買入	+2,000		+1,300			
国債補完供給	▲1,300		+1,300			
当座預金増減	▲21,800		▲9,000		+65,000	
当座預金残高	4,909,100		4,900,100		4,965,100	
準備預金残高	4,483,800		主な需給要因			
積み終了先	4,483,800		国庫短期証券発行償還		源泉税揚げ	
超過準備	4,483,800		還(3M)		年金定時払い	
非準備先残高	425,300				国債発行償還(個人)	
準備預金進捗率	100.0%					
平均	93.3%					
乖離率	6.7%					

10月10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(10/10~10/14)	1,416	1,416	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円] 所要 [億円]

10月9日時点	6,143,800	今積期の所要準備額	3,978,100
		10月14日以降の残り所要	
		積数	0
		平均	0

国庫短期証券入札予定

10月16日	1年(第1338回)
10月17日	3ヶ月(第1339回)
10月24日	3ヶ月
10月31日	3ヶ月

国債入札予定

10月15日	20年
10月21日	10年クワイメート・トランジション
10月31日	2年
11月5日	10年

今月の国債買入オペ予定 [億円]

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	1000	1,000	8				10月8日	0
1年超3年以下	3000	3,000	8	16	22		10月8日	2
3年超5年以下	2800	3,250	16	22	28		9月29日	3
5年超10年以下	3050	3,050	8	16	28		10月8日	2
10年超25年以下	1150	1,150	8	22	28		10月8日	2
25年超	750	750	16	28			9月29日	2
物価連動債	500	500	28				9月29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