



デイリーシグナル

2025年10月15日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

	10月8日	10月9日	10月10日	10月14日
加重平均金利	0.477	0.478	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.492	0.494	0.498	0.498
無コール残	87,940	89,120	80,152	78,189
ON	32,262	33,512	28,624	27,187
その他	55,678	55,608	51,528	51,002
有コール残	25,966	26,178	26,967	26,770

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボ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、無担保コール残高は無担保コール残高の値。

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボ レート
O/N	0.450	0.478	0.477	0.498
T/N	-	-	-	0.498
S/N	-	-	-	-
1W	0.484	0.610	0.532	0.489
2W	0.460	0.600	0.481	0.488
3W	-	-	0.560	0.489
1M	-	-	-	0.494
2M	-	-	-	-
3M	0.610	0.620	0.616	0.545
6M	-	-	-	0.612
1Y	-	-	-	0.716

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月15日	10月16日	10月16日	10月17日	10月17日	10月17日
券		+500		+400		+0
財政		+71,300		▲7,400		+4,000
過不足		+71,800		▲7,000		+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
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000				
CP等買入	▲100					
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+1,100	▲1,500	+1,500			
当座預金増減		+71,200		▲5,500		+4,000
当座預金残高		4,968,000		4,962,500		4,966,500
準備預金残高		4,515,200				主な需給要因
積み終了先		4,515,200				国債発行 (20年)
超過準備		4,515,200				
非準備先残高		452,800				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

10月15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(10/15~10/16)						
	1,551	1,551	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月14日時点 6,109,500

所要

所要		[億円]
来積期の所要準備額	10月16日以降の残り所要	4,104,100
積数		4,104,100
平均		132,400

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21日	10年プライマート・トランジション
10月31日	2年
11月5日	10年
11月11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	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