



## デイリーシグナル

2024年11月1日(金)

### 短期市場の推移

	10月28日	10月29日	10月30日	10月31日
加重平均金利	0.228	0.228	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.236	0.183	0.143	0.234
無コール残	76,044	77,574	78,109	76,588
ON	28,249	29,609	29,844	28,453
その他	47,795	47,965	48,265	48,135
有コール残	36,651	36,969	36,498	34,869

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 [%]

### 11月5日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10月のマネタリーベース		(米)	9月の貿易収支	
	-		(米)	ISM非製造業指数	
	-		(米)	大統領選挙	

	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	0.241
T/N	-	-	-	0.240
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.390	0.203
2W	-	-	0.227	0.203
3W	-	-	-	0.202
1M	0.280	0.420	0.297	0.204
2M	-	-	0.310	-
3M	-	-	0.353	0.230
6M	-	-	-	0.289
1Y	-	-	-	0.339

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。

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

資金需給	[億円]					
	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月1日		11月5日		11月6日	
券	+200		▲200		+300	
財政	▲21,500		+19,300		+6,000	
過不足	▲21,300		+19,100		+6,300	
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	▲100					
国債補充供給	+7,900	▲7,700	+7,700			
当座預金増減	▲21,200		+26,800		+6,300	
当座預金残高	5,462,400		5,489,200		5,495,500	
準備預金残高	4,909,700		主な需給要因			
積み終了先	4,908,900		法人税・消費税・保険税			
超過準備	4,908,900		揚げ			
非準備先残高	552,700		普通交付税交付金			
準備預金進捗率	99.9%		国庫短期証券発行・償還			
平均	64.5%		(3M)			
乖離率	35.4%					

### 11月1日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(11/1~11/5)	7,876	7,876	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月31日時点 6,727,100	今積期の所要準備額 4,041,000
	11月5日以降の残り所要
	積数 1,500
	平均 100

### 国庫短期証券入札予定

11月7日	6ヶ月(第1267回)
11月8日	3ヶ月(第1268回)
11月15日	3ヶ月
11月19日	1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	6				10月2日	1
1年超3年以下	3250	3,250	6	12	18	22	10月18日	4
3年超5年以下	3250	3,250	6	12	22	28	10月28日	4
5年超10年以下	3750	3,750	12	18	22	28	10月28日	4
10年超25年以下	1500	1,500	12	18	28		10月28日	3
25年超	750	750	6	22			10月28日	2
物価連動債	600	600	28				10月28日	1
変動利付債	-	300					4月14日	-

### 国債入札予定

11月7日	10年
11月11日	物価連動
11月13日	30年
11月15日	5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