



## デイリーシグナル

2024年11月8日(金)

### 短期市場の推移

	[億円] [%]			
	11月1日	11月5日	11月6日	11月7日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.240	0.238	0.233	0.231
無コール残	79,508	82,693	82,931	81,928
ON	29,853	32,818	33,326	33,013
その他	49,655	49,875	49,605	48,915
有コール残	36,705	37,387	36,888	37,162

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11日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	金融政策決定会合における主な意見 (10月30~31日)			
	-		-	
	-		-	

	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	0.164
T/N	-	-	-	0.235
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.228	0.204
2W	-	-	0.290	0.204
3W	-	-	-	0.204
1M	-	-	0.370	0.208
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.350	0.246
6M	-	-	-	0.309
1Y	-	-	-	0.360

### 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。

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8日		11月11日		11月12日	
券	+300		+500		+1,000	
財政	▲23,100		+1,600		▲6,000	
過不足	▲22,800		+2,100		▲5,000	
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	▲600		▲100			
国債補充供給	+7,900	▲7,800	+7,800			
当座預金増減	▲23,300		+9,800		▲5,000	
当座預金残高	5,463,200		5,473,000		5,468,000	
準備預金残高	4,901,900		主な需給要因			
積み終了先	4,901,800		国庫短期証券発行・		国債発行(物連10	
超過準備	4,901,800		償還(3M-6M)		年)	
非準備先残高	561,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	83.9%					
乖離率	16.0%					

### 11月8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(11/8~11/11)	7,930	7,930	▲0.050	▲0.050		
	14	14	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース	所要
11月7日時点 6,729,400	今積期の所要準備額 4,035,500
	11月11日以降の残り所要
	積数 200
	平均 0

### 国庫短期証券入札予定

11月15日	3ヶ月(第1269回)
11月19日	1年
11月22日	3ヶ月
11月29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	6		0
1年超3年以下	3250	3,250	6 12 18 22	11月6日	3
3年超5年以下	3250	3,250	6 12 22 28	11月6日	3
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	11月6日	1
物価連動債	600	600	28	10月28日	1
変動利付債	-	300	-	2023/4/14	-

### 国債入札予定

11月11日	物価連動
11月13日	30年
11月15日	5年
11月21日	20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