



デイリーシグナル

2024年11月13日(水)

短期市場の推移

	11月7日	11月8日	11月11日	11月12日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.231	0.235	0.237	0.228
無コール残	81,928	80,824	80,540	80,812
ON	33,013	30,414	30,390	32,782
その他	48,915	50,410	50,150	48,030
有コール残	37,162	37,266	39,661	40,155

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 [%]

	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	0.220	0.275	0.228	0.240
T/N	-	-	-	0.222
S/N	-	-	-	-
1W	0.226	0.280	0.235	0.207
2W	-	-	0.227	0.207
3W	-	-	-	0.208
1M	-	-	-	0.209
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.253
6M	-	-	-	0.323
1Y	-	-	-	0.384

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

11月14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 週間の新規失業保険申請件数	-
-	-	(欧) 7~9月GDP	-
-	-	-	-

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%~0.228%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+0.001%の0.228%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	
	11月13日	11月14日	11月14日	11月15日	11月15日	11月16日
券	+100	▲200	▲200	+1,000	+1,000	
財政	+3,500	▲9,600	▲9,600	▲300	▲300	
過不足	+3,600	▲9,800	▲9,800	+700	+700	
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
国債買入		+11,600				
共通担保(全店)	▲8,000	+8,100	▲100			
CP等買入	▲200					
国債補完供給	+5,600	▲4,600	+4,600			
当座預金増減	+16,100	▲5,300	▲5,300	+700	+700	
当座預金残高	5,475,400	5,470,100	5,470,100	5,470,800	5,470,800	
準備預金残高	4,908,800	主な需給要因				
積み終了先	4,908,700	国債発行(30年)	国債発行償還(個人)			
超過準備	4,908,700					
非準備先残高	566,600					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	93.5%					
乖離率	6.5%					

11月13日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(11/13~11/14)	4,728	4,728	▲0.050	▲0.050		
共通担保(全店)(11/13~11/14)	1,000	54	54			

マネタリーベース [億円]
11月12日時点 6,701,400

所要	今積期の所要準備額
11月14日以降の残り所要	4,035,500
積数	0
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(第1270回)
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12日 2
3年超5年以下	3250	3,250	6 12 22 28		11月12日 2
5年超10年以下	3750	3,750	12 18 22 28		11月12日 3
10年超25年以下	1500	1,500	12 18 28		11月12日 2
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	-		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