



短期市場の推移

	11月8日	11月11日	11月12日	11月13日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.228
東京レポレート(TN)	0.235	0.237	0.228	0.222
無コール残	80,824	80,540	80,812	79,627
ON	30,414	30,390	32,782	31,127
その他	50,410	50,150	48,030	48,500
有コール残	37,266	39,661	40,155	39,438

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	0.228	0.227	0.192
T/N	-	-	-	0.204
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.206
2W	-	-	0.290	0.206
3W	-	-	-	0.207
1M	0.290	0.300	0.297	0.208
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.254
6M	-	-	-	0.335
1Y	-	-	-	0.390

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	実質GDP (7~9月・速報値)		(米) 小売売上高 (10月)		
	-		-		
	-		-		

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▲0.001%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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月14日		11月15日		11月18日	
券	▲200		+0		+0	
財政	▲11,200		+700		▲20,000	
過不足	▲11,400		+700		▲20,000	
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					
CP等買入			▲300			
被災地金融機関支援					▲100	+100
国債補完供給	+4,600	▲4,800	+4,800			
当座預金増減	▲11,700		+5,200		▲20,000	
当座預金残高	5,463,700		5,468,900		5,448,900	
準備預金残高	4,903,800		主な需給要因			
積み終了先	4,903,800		国債発行償還(個人)		国債発行(5年)	
超過準備	4,903,800				国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準備先残高	559,900					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.8%					
乖離率	3.2%					

11月14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(11/14~11/15)	4,943	4,943	▲0.050	▲0.050		
	0	0				
被災地金融機関支援(2024/11/18~2025/11/17)	57	57				

マネタリーベース [億円]
11月13日時点 6,717,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,035,500
11月15日以降の残り所要	
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

国債入札予定

11月15日	5年
11月21日	20年
11月27日	40年
11月29日	2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				11月6日	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	-				2023/4/14	-

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