



## デイリーシグナル

2024年11月20日(水)

### 短期市場の推移

	11月14日	11月15日	11月18日	11月19日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.204	0.235	0.234	0.238
無コール残	78,248	79,790	76,931	81,224
ON	29,898	31,720	28,451	31,974
その他	48,350	48,070	48,480	49,250
有コール残	40,043	41,495	39,433	40,148

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	0.227	0.231
T/N	-	-	0.275	0.238
S/N	-	-	-	-
1W	0.226	0.390	0.229	0.211
2W	-	-	0.270	0.211
3W	-	-	-	0.212
1M	-	-	0.295	0.214
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.360	0.274
6M	-	-	-	0.352
1Y	-	-	-	0.411

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21日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:10	植田日銀総裁の講演		-	
	-		-	
	-		-	

### 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。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月20日	11月21日	11月21日	11月22日	11月22日	11月22日
券	▲200	▲700	▲700	▲700	▲700	+0
財政	▲10,000	+7,300	+7,300	+7,300	+7,300	▲14,000
過不足	▲10,200	+6,600	+6,600	+6,600	+6,600	▲14,000
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	▲100	▲200	▲200	▲200	▲200	▲200
社債等買入				+300		
国債補完供給	+8,600	▲4,700	+4,700			
当座預金増減	▲6,400	+11,400	+11,400	+11,400	+11,400	▲14,000
当座預金残高	5,444,800	5,456,200	5,456,200	5,456,200	5,456,200	5,442,200
準備預金残高	4,877,300	主な需給要因				
積み終了先	4,872,800	国債発行(20年)				
超過準備	4,866,500					
非準備先残高	567,500					
準備預金進捗率	99.4%					
平均	16.7%					
乖離率	82.8%					

### 11月20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(11/20~11/21)	4,790	4,790	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]  
11月19日時点 6,693,100

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,912,200
11月21日以降の残り所要	
積数	22,200
平均	900

### 国債短期証券入札予定

11月22日	3ヶ月(第1271回)
11月29日	3ヶ月
12月6日	3ヶ月
12月9日	6ヶ月

### 国債入札予定

11月21日	20年
11月27日	40年
11月29日	2年
12月3日	10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18日	1
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18日	2
10年超25年以下	1500	1,500	12	18	28		11月18日	1
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