



### 短期市場の推移

	11月11日	11月12日	11月13日	11月14日
加重平均金利	0.227	0.227	0.228	0.227
東京レポレート(TN)	0.237	0.228	0.222	0.204
無コール残	80,540	80,812	79,627	78,248
ON	30,390	32,782	31,127	29,898
その他	50,150	48,030	48,500	48,350
有コール残	39,661	40,155	39,438	40,043

[億円] [%]

### 11月18日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:05	植田日銀総裁の挨拶		-	
17:00	10月の業態別日銀当座預金残高		-	
	-		-	

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

### 本日の市況

	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	0.203
T/N	-	-	-	0.235
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.208
2W	-	-	0.295	0.208
3W	-	-	-	0.208
1M	-	-	0.350	0.210
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.256
6M	-	-	-	0.349
1Y	-	-	-	0.401

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。ビット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

ビット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15日	11月18日	11月18日	11月19日	11月19日	11月19日
券	+100	+200	+200	+200	+1,000	+1,000
財政	▲300	▲21,700	▲21,700	▲21,700	▲5,000	▲5,000
過不足	▲200	▲21,500	▲21,500	▲21,500	▲6,000	▲6,000
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	▲300					
被災地金融機関支援			▲100	+100		
国債補完供給	+4,800	▲5,700	+5,700			
当座預金増減	▲1,400	▲15,800	▲15,800	▲15,800	▲6,000	▲6,000
当座預金残高	5,462,300	5,446,500	5,446,500	5,446,500	5,440,500	5,440,500
準備預金残高	4,905,600	主な需給要因				
積み終了先	4,905,600	国債発行(5年)				
超過準備	4,905,600	国庫短期証券発行・償還(3M)				
非準備先残高	556,700					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	100.0%					
乖離率	0.0%					

### 11月15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(11/15~11/18)	5,894	5,894	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]  
11月14日時点 6,705,800

所要	所要
来積期の所要準備額	3,912,200
11月18日以降の残り所要	
積数	89,100
平均	3,200

### 国庫短期証券入札予定

11月19日	1年(第1270回)
11月22日	3ヶ月(第1271回)
11月29日	3ヶ月
12月6日	3ヶ月
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