



## デイリーシグナル

2022年10月7日(金)

### 短期市場の推移

	10月3日	10月4日	10月5日	10月6日
加重平均金利	▲0.065	▲0.059	▲0.052	▲0.039
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.116	▲0.129	▲0.113
無コール残	140,224	132,827	150,944	158,611
ON	83,281	71,439	83,126	85,313
その他	56,943	61,388	67,818	73,298
有コール残	30,327	31,975	32,249	32,168

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	▲0.075	0.001	▲0.021	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.025	▲0.048	▲0.094
2W	-	-	▲0.060	▲0.106
3W	-	-	-	▲0.116
1M	-	-	▲0.060	▲0.126
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.161
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.144

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

### 10月11日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本		海外	
	実績	予想	実績	予想
8:50	8月国際収支 (経常収支)	621億円	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.02%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.015%の水準で取引された。週末4日積みであり、ビッドサイドが積極的に調達したことでON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.018%の▲0.021%となった。本日公表された10月積み期の基準比率は前積み期対比+6.5%の49.5%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲が減退し、出合いの水準は本日対比で低下する見込み。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月7日	10月11日	10月11日	10月12日	10月12日	10月12日
券	▲200		+600		+1,000	
財政	▲6,700		▲11,800		+3,000	
過不足	▲6,900		▲11,200		+4,000	
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
国債買入		+300				
共通担保(全店)					▲11,300	
CP等買入	▲200		▲200			
社債等買入	▲200		▲100			
国債補充供給	+17,100	▲15,000	+15,000			
当座預金増減	▲4,900		+3,500		▲7,300	
当座預金残高	4,854,600		4,858,100		4,850,800	
準備預金残高	4,230,600					
積み終了先	4,230,600					
超過準備	4,230,600					
非準備先残高	624,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	83.3%					
乖離率	16.6%					

### 10月7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
国債買入(固定利回り方式)(10/11~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(10/7~10/11)						
	14,952	14,952	▲0.350	▲0.354		
	0	0				

マネタリーベース (億円)  
10月6日時点 6,109,900

所要	今積期の所要準備額
10月11日以降の残り所要	3,744,800
積数	100
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

10月14日	3ヶ月(第1114回)
10月19日	1年
10月21日	3ヶ月
10月27日	3ヶ月

### 国債入札予定

10月12日	30年
10月14日	5年
10月18日	20年
10月27日	2年

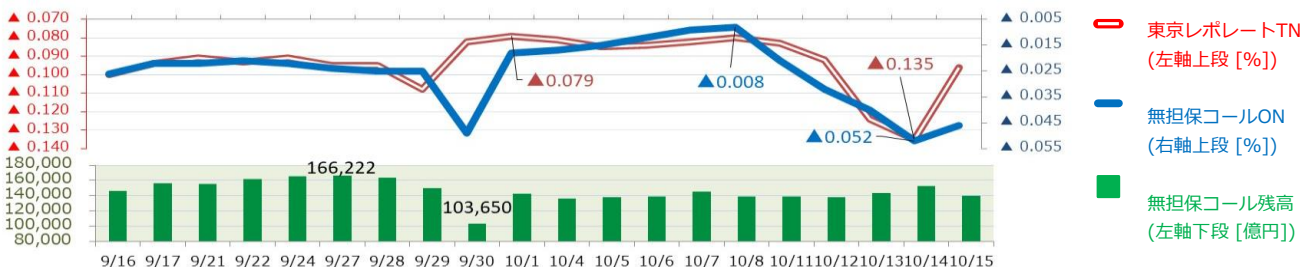
### 今月の国債買入オペ予定

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	月1回	10月5日	0
1年超3年以下	4750	4,750	5 11 17 21	10月5日	3
3年超5年以下	4750	4,750	5 11 21 26	10月5日	3
5年超10年以下	5500	5,500	11 17 21 26	9月30日	4
10年超25年以下	2500	1,250	11 26	9月30日	2
25年超	1000	500	17 26	9月30日	2
物価連動債	600	600	月1回	9月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	1

### 1年前の市場推移

○2021年9月積み期 [9月16日~10月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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