



デイリーシグナル

2022年10月11日(火)

短期市場の推移

	10月4日	10月5日	10月6日	10月7日
加重平均金利	▲0.059	▲0.052	▲0.039	▲0.021
東京レボレート(TN)	▲0.116	▲0.129	▲0.113	▲0.087
無コール残	132,827	150,944	158,611	159,973
ON	71,439	83,126	85,313	86,405
その他	61,388	67,818	73,298	73,568
有コール残	31,975	32,249	32,168	31,917

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.075	0.001	▲0.022	▲0.081
T/N	-	-	-	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.060	▲0.090
2W	-	-	0.050	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.113
1M	-	-	-	▲0.126
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.157
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.144

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

10月12日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	8月コア機械受注[前月比]	▲1.0%	21:30	(米)9月生産者物価コア指数 [前年比]	7.3%
				(米) FOMC議事要旨 (9月20、21日両日開催分)	

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。調達意欲は4日積みであった先週末と大きく変わらず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.020	▲0.023 ~ ▲0.015	▲0.025 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

調達意欲は大きく変わらず、出合水準は本日対比横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月11日	10月12日	10月12日	10月13日	10月13日
券	+500	+700	+700	+2,000	+2,000
財政	▲13,100	+2,500	+2,500	▲12,000	▲12,000
過不足	▲12,600	+3,200	+3,200	▲10,000	▲10,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+18,000		
共通担保(全店)			▲11,300	+8,200	
CP等買入	▲200		▲100		
社債等買入	▲100				
国債補充供給	+15,000	▲16,400	+16,400		
当座預金増減	▲14,300	+34,400	+34,400	▲10,000	▲10,000
当座預金残高	4,840,300	4,874,700	4,874,700	4,864,700	4,864,700
準備預金残高	4,254,000				
積み終了先	4,254,000				
超過準備	4,254,000				
非準備先残高	586,300				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	86.7%				
乖離率	13.3%				

10月11日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(10/12~)						
5~10年	350	350				
5~10年	0	0				
国債買入(10/12~)						
1~3年	4,750	15,432	4,755	0.006	0.007	66.2
3~5年	4,750	8,509	4,754	0.008	0.010	9.0
5~10年	5,500	11,359	5,502	0.005	0.012	23.6
10~25年	2,500	5,341	2,514	0.028	0.029	87.1
米ドル資金供給(10/13~10/20)	0	0	3,330	3,330		
国債補充供給(10/11~10/12)	16,204	16,204	▲0.350	▲0.350		
	102	102	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(10/12~10/26)	8,150	8,150				

マネタリーベース

10月7日時点	6,105,300
---------	-----------

所要

今積期の所要準備額	3,744,800
10月12日以降の残り所要	
積数	0
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

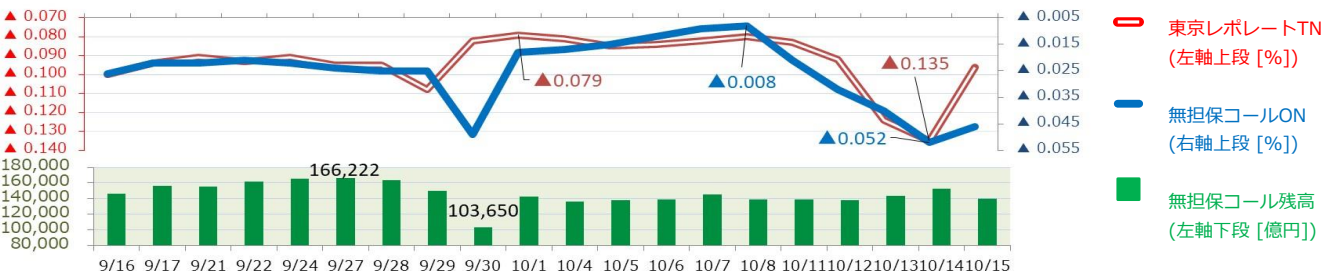
今月の国債買入オペ予定

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11日	2
3年超5年以下	4750	4,750	5 11 21 26	10月11日	2
5年超10年以下	5500	5,500	11 17 21 26	10月11日	3
10年超25年以下	2500	2,500	11 26	10月11日	1
25年超	1000	500	17 26	10月11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