



## デイリーシグナル

2022年10月14日(金)

### 短期市場の推移

	10月7日	10月11日	10月12日	10月13日
加重平均金利	▲0.021	▲0.022	▲0.026	▲0.033
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.081	▲0.084	▲0.086
無コール残	159,973	139,552	143,109	149,608
ON	86,405	72,869	77,906	85,415
その他	73,568	66,683	65,203	64,193
有コール残	31,917	31,153	33,222	30,630

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	▲0.080	0.001	▲0.042	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.008	▲0.092
2W	▲0.065	▲0.060	▲0.063	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.113
1M	-	-	-	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.156
6M	-	-	-	▲0.148
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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 ニューヨーク連銀製造業景気指数	-1.0
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.035%の水準で取引された。新積み期にかかる三日積みとなるなか一部の先が調達を控える動きもあり、出合のレートは低下し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.042%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.050	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.060 ~ ▲0.030

### 翌営業日のマーケット

一部の先が調達を控えることも想定され、本日対比出合レートは低下を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月14日	10月17日	10月17日	10月18日	10月18日
券	▲300	+300	+300	+0	+0
財政	+76,900	▲40,900	▲40,900	▲3,000	▲3,000
過不足	+76,600	▲40,600	▲40,600	▲3,000	▲3,000
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	+1,800	+1,200	+1,200	スタート	スタート
CP等買入	▲300	▲500	▲500		
国債補完供給	+12,300	▲14,000	+14,000		
当座預金増減	+76,400	▲21,900	▲21,900	▲3,000	▲3,000
当座預金残高	4,930,900	4,909,000	4,909,000	4,906,000	4,906,000
準備預金残高	4,299,600				
積み終了先	4,299,600				
超過準備	4,299,600				
非準備先残高	631,300				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	100.0%				
乖離率	0.0%				

### 10月14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)(10/17~)						
5~10年	1,184	1,184				
5~10年	0	0				
国債補完供給(10/14~10/17)						
	14,012	14,012	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)  
10月13日時点 6,104,400

所要	(億円)
来積期の所要準備額	3,874,800
10月17日以降の残り所要	
積数	633,900
平均	21,100

### 国庫短期証券入札予定

10月19日	1年(第1115回)
10月21日	3ヶ月(第1116回)
10月27日	3ヶ月
11月4日	3ヶ月
10月18日	20年
10月27日	2年
11月1日	10年
11月7日	物価連動

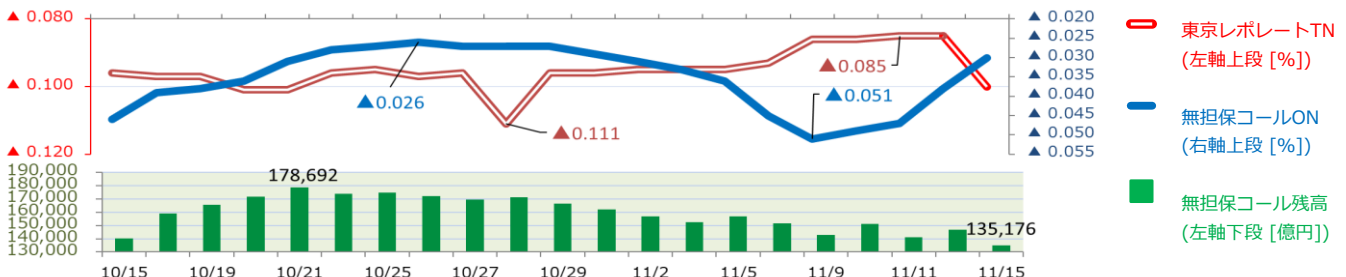
### 今月の国債買入オペ予定

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	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10月積み期 [10月15日~11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