

ウィークリー・レポート

平成 29 年 5 月 29 日 No.761

上田八木短資 証券営業部

先週の話

足許 GC は週初、 $\Delta 0.085\%$ 近辺の出会いから始まり、週央まで同水準で推移した。TDB3M・40 年債の発行日となる 29 日受渡しでは $\Delta 0.06\%$ 台まで上昇した。週末には国庫短期証券・国債買入オペが合計 1 兆 2,500 億円オファーされ、 $\Delta 0.07\%$ 台に小幅低下し越週した。SC 取引では、5 年 130 回債が週を通して ON 物・ターム物ともに $\Delta 0.50\%$ 台での出会いが見られた。その他 2 年 372・373・374・375 回債、5 年 130・131 回債、10 年 334・335・336・338・341・343・344・345・346 回債、20 年 157・159・160 回債、30 年 52・53・54 回債、40 年 9 回債などに引合いが多く見られた。

スペシャル取引の銘柄

2 年 債 … 371-376

5 年 債 … 105 106 116 120 121 123-127 129-131

10 年 債 … 290 296 298 300-303 305-310 312 313-330 332-339 341-346

20 年 債 … 53 63 68 81 85 91 94 99 100 105 106 109-111 113 117 120 121 124 126 133 134 136-138
141-143 150-152 154-160

30 年 債 … 19 20 21 27 31 35 36 37 40 45 48 49 51-53

先週のレポート

2 年 376 回	5 年 131 回	10 年 346 回	20 年 160 回	GC(T+1~T+2)
-0.08~-0.10	-0.085~-0.095	-0.08~-0.16	-0.095~-0.12	-0.06~-0.09

今週の材料

5 月 29 日	欧 トランプ ECB 総裁、講演
5 月 30 日	完全失業率 (4 月) 有効求人倍率 (4 月) 基調的なインフレ基調を補足するための指標 (日銀) 米 個人所得・支出(4 月) 米 消費者信頼感指数(5 月) 欧 ユーロ圏景況感指数 (5 月)
5 月 31 日	鉱工業生産指数 (4 月) 米 ショック製造業景況指数 (5 月) 米 中古住宅販売成約指数 (4 月) 米 ダラス連銀総裁、講演 米 ベンチマーク 欧 ユーロ圏失業率 (4 月) 欧 ユーロ圏消費者物価指数(5 月、速報値)
6 月 1 日	日銀・原田審議委員、講演 米 ADP 雇用統計(5 月) 米 週間新規失業保険申請件数(5 月 27 日終了週) 米 ISM 製造業景況指数 (5 月) 欧 ユーロ圏製造業 PMI (5 月、改定値)
6 月 2 日	マネーベース(5 月) 日銀営業毎旬報告 (5 月 31 日現在) 日銀が保有する国債の銘柄別残高 日銀による国庫短期証券の銘柄別買入額 米 雇用統計 (5 月) 米 貿易統計 (4 月) 欧 ユーロ圏生産者物価指数 (4 月)