

ウィークリー・レポート

平成 29 年 11 月 20 日 No.785

上田八木短資 証券営業部

先週の話題

足許 GC は週初 $\Delta 0.085\%$ ~ $\Delta 0.09\%$ と先週末対比上昇して始まり、T/Nでは $\Delta 0.07\%$ 台の取引も一部見られた。以降週央にかけては $\Delta 0.10\%$ ~ $\Delta 0.105\%$ に低下。TDB1Y、3Mの発行が重なった 20 日受渡しでもレートの上昇は見られず、週末には国庫短期証券・国債買入れオペがオファーされ、 $\Delta 0.11\%$ ~ $\Delta 0.12\%$ に低下し越週した。SC 取引では、週を通して 10 年 347 回債、348 回債の bid が多く、347 回債は概ね $\Delta 0.10\%$ 台後半~ $\Delta 0.20\%$ 近辺。348 回債は週初 $\Delta 0.10\%$ 台前半の出合いであったが、15 日の国債買入オペ後レートが低下。週後半にかけて $\Delta 0.10\%$ 台半ば~後半で多く取引された。他 2 年 380・381・382 回債、5 年 131・132・133 回債、10 年 336・340・341・342・346 回債、20 年 161・162 回債、30 年 55・56 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 … 371 373 377-382

5 年 債 … 114 116-118 121-123 125 127 129 130-133

10 年 債 … 290 293 296 298 301-303 305-307 309-348

20 年 債 … 41 43 50 71 74 76 77 79 83 84 85 96 97 99 100 103 105 106 108 109 112 113 116 118
119 121 123 124 126 127 132 133 135 139 140 142-145 147 149-152 154-158 161 162

30 年 債 … 11 20 21 22 24 27 28 29 35 36 37 40-43 49-53 55 56

先週のレポレート

2 年 382 回	5 年 133 回	10 年 348 回	20 年 162 回	GC(T+1~T+2)
-0.11~-0.455	-0.10~-0.13	-0.10~-0.185	-0.105~-0.165	-0.07~-0.12

今週の材料

11 月 20 日	貿易統計(10 月) 米 景気先行指標総合指数(10 月) 欧 ドラギ ECB 総裁、欧州議会で公聴会出席(フリュツェル)
11 月 21 日	米 中古住宅販売件数(10 月) 米 イェレン FRB 議長講演
11 月 22 日	日銀営業毎旬報告(11 月 20 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 新規失業保険申請件数(前週分) 米 耐久財受注(10 月速報値) 米 FOMC 議事録(10 月 31-11 月 1 日開催分) 欧 ユーロ圏消費者信頼感(11 月速報値) 米 シカゴ大学消費者マインド指数(11 月確定値)
11 月 23 日	米 祝日 欧ユーロ圏総合 PMI(11 月、速報値) 欧ユーロ圏サービス業 PMI(11 月、速報値) 欧 ECB 議事要旨
11 月 24 日	独 Ifo 景況感指数(11 月)