

WEEKLY SIGNAL

平成28年10月7日(金) 1344号

上田八木短資株式会社

来週の市場とレート予想					
	10/10 (月)	10/11 (火)	10/12 (水)	10/13 (木)	10/14 (金)
無担保O/N	△0.086% ~ 0.001%				
銀行券	休日	+ 700	ト ン	ト ン	△ 1,000
財政他		△ 40,300	+ 2,000	ト ン	+ 63,000
資金需給		不 39,600	余 2,000	ト ン	余 62,000
主な要因		国庫短期証券発行・償還 (3M・6M) 10年物価連動国債発行		源泉税揚げ	年金定時払い 国債発行(30年)
オペ期日		共通担保(全店) △ 2,500 CP等買入 △ 300 国債補完供給 + 400			共通担保(全店) △ 100
オペスタート	休日	共通担保(全店) + 2,000 CP等買入 + 3,500 ETF買入 + 200	国債買入 + 7,100 短国買入 + 30,000		
(日本)		景気ウォッチャー調査(9月)	原田日銀審議委員講演 (松本市) 機械受注(8月) 日銀営業毎旬報告 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	原田日銀審議委員 記者会見の要旨	企業物価指数(9月)
(海外)	米 祝日(コロンバスター、 米国債市場は休場) 欧 ユーロ圏財務相会合 欧 ノーベル経済学賞 受賞者の発表	欧 EU財務相理事会	米 FOMC議事録(9/20-9/21 の会合分) 米 NY連銀総裁講演 欧 ユーロ圏鉱工業生産(8月)	米 新規失業保険申請件数	米 イエレンFRB議長講演 米 ボストン連銀総裁講演 米 MMF新規制施行 米 小売売上高(9月) 米 PPI(9月) 米 ミシガン大学消費者 マインド指数(10月)

【インターバンク市場】

無担保ターム物	予想レンジ
SPOT 1M	△0.05 ~ 0.001
SPOT 2M	△0.05 ~ 0.001
SPOT 3M	△0.06 ~ 0.001
SPOT 6M	△0.06 ~ 0.001

【オープン市場】

CP3M(a-1+)	0.000 ~ 0.005
TDB 3M	△0.500 ~ △0.300
現先(on/1w)	△0.100 ~ 0.000

<TDB>

6日に国庫短期証券3M第638回債の入札が行われたが、最高落札レートは△0.3120%(前回債△0.3407%)、平均落札レートは△0.3274%(同△0.3547%)と前回債と比べて利回りは上昇した。セカンダリーは3Mで△0.315%近辺の地合いとなっている。6Mは△0.42%近辺の地合い、1Yは目立った出合は見られなかった。来週13日に

<レポ>

足許GCは週初▲0.085%~▲0.09%の出合から始まり、週央まで同水準で推移。短国3M・6Mの発行日となる11日受渡では、▲0.07%台までレートが上昇した。週末には国債・短国買入れオベが3兆7,100億円オファーされたが、レート水準に大きな変化はなく、▲0.075%~▲0.08%を中心に取引され、越週した。SC取引では、10年344回債で週初▲0.20%台の出合が多く見られたが、リオープン後のビッドは限定的であった。また10年342回債は週末▲0.20%~▲0.20%台半ばで取引されていた。他では5年127・128・129回債、10年341・343回債、20年155・156・157回債、30年50・51・52回債などに引き合いが多く見られた。

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。