

レポウィークリー リビュー

〔先週の概況(1/30~2/3)〕

先週の O/N GC は 月末を跨ぐ取引で資金出しの動きが活発だった影響を受け、0.1025~0.0975% 中心の出会いから一部0.095%まで買い進まれる場面も見られるなど、落ち着き基調での滑り出しとなった。その後は週後半に近づく、短国や10年債の発行の影響を受け多少ファンディングニーズが戻りはじめ、再び0.10%~0.103%へとレート持ち直す動きとなり週を終えた。ターム GCは1w~1Mで足元と同水準の0.0975%~0.10%中心の出会いが見受けられている。SCは5年債92回債が今週になりビッドが増える展開、5y債のカレントである5y101、5y102は月末を抜けた後にビッド減り、緩み方向の動きとなった。今週は短国の入札が予定されている中、積みの進捗が進んだ状態で積み期間終盤に差し掛かり、GCレートの予測し難い展開となると思われる。

〔主要銘柄レポレートの動向〕

銘柄		期間	レポレート				
GC		T+0	0.0975	~			0.1075
		T/N	0.0925	~			0.1030
		S/N	0.0975	~			0.1030
		T+3	0.0975	~			0.1030
		1w		~			
SC	2y-312	O/N	0.0900	~			0.1000
	5y-102	O/N	0.0300	~			0.0600
	#319	O/N	0.0300	~			0.0600
		2y-309	5y-92	5y-96	5y-98	5y-100	
		5y-101	#311	#317	#318	#320	
		SL-125	SL-126	SL-129	SL-132	SL-133	

*東京レポ・レート

ターム	翌日物			1W	2W	3W	1M	3M	6M	1Y
Date	T+0	T+1	S/N	T+3	T+3	T+3	T+3	T+3	T+3	T+3
2012/1/30	0.101%	0.100%	0.101%	0.103%	0.103%	0.104%	0.105%	0.105%	0.109%	0.114%
2012/1/31	0.100%	0.100%	0.101%	0.103%	0.103%	0.104%	0.105%	0.105%	0.109%	0.114%
2012/2/1	0.100%	0.100%	0.100%	0.102%	0.103%	0.104%	0.105%	0.105%	0.109%	0.114%
2012/2/2	0.100%	0.100%	0.100%	0.102%	0.103%	0.104%	0.105%	0.105%	0.109%	0.114%
2012/2/3	0.100%	0.101%	0.102%	0.102%	0.103%	0.104%	0.105%	0.105%	0.109%	0.114%

*先週の実績(買い現先オ・億円)

(落札レート、按分率は市場推定)

	オファー	スタート	エンド	応札額(億)	落札額(億)	落札レート	按分率	平均レート
買現先オペ	-	-	-	-	-	-	-	-

*今週以降の期日(買い現先オペ) 億円

	2/7	2/8	2/9	2/10	2/13	2/14	2/15
買現先オペ	-	-	-	-	-	-	-

〔新発債情報〕

銘柄名	発行年月日	初回利払日	償還日	発行価格	年利率
2年利付国債(第313回)	2012/2/15	2012/8/15	2014/2/15	99.9430	0.13%
国庫短期証券(第255回)	2012/2/6	-	2012/5/7	99.9749	-

Date	オーバーナイト S/NGC (BID rate)			無担 オーバーナイト(日銀発表)		
	HIGH	LOW	Ave.	HIGH	LOW	Ave.
1/30	0.1025%	0.1000%	0.1000%	0.1500%	0.0600%	0.0820%
1/31	0.1025%	0.0975%	0.1000%	0.1500%	0.0500%	0.0750%
2/1	0.1000%	0.0950%	0.0975%	0.1500%	0.0500%	0.0730%
2/2	0.1000%	0.0975%	0.1000%	0.1500%	0.0600%	0.0760%
2/3	0.1025%	0.1000%	0.1000%	0.1250%	0.0600%	0.0790%