



<来週の資金需給予想とイベント予定>

(単位：億円)

日付	資金需給予想			主な要因	オペ期日	オペスタート	イベント
	銀行券要因	財政等要因	資金過不足				
6/5 (月)	+ 700	▲ 4,100	▲ 3,400		CP等買入 ▲ 300 国債補完供給 + 34,100	国債買入 + 12,300	米：ISM非製造業総合景況指数（5月）
6/6 (火)	+ 1,000	▲ 3,000	▲ 2,000				
6/7 (水)	トン	▲ 9,000	▲ 9,000	国債発行（30年）			日：日銀、コール市場残高（5月） 米：貿易収支（4月）
6/8 (木)	+ 1,000	+ 1,000	+ 2,000				日：GDP（1Q） 米：新規失業保険申請件数（6月3日終了週） 欧：ユーロ圏GDP（1Q）
6/9 (金)	トン	▲ 5,000	▲ 5,000	流動性供給			

<インターバンク>

日銀当座預金残高は週初5月29日、544兆3,300億円から始まった。その後は6月1日、2日にかけての税・保険揚げを主因に533兆6,200億円（速報）まで減少し越週した。

無担保コールON物加重平均金利は週初、前週末対比▲0.001%の▲0.062%から始まった。その後週末にかけて運用資金が増加し、5月31日の同金利は▲0.071%まで低下した。3日積みとなる6月2日についても▲0.072%（速報）まで低下し、越週した。

ターム物は1W～2W物を中心に、主に▲0.065%～▲0.050%の水準で出合いが見られた。

来週の主な予定は、国内で6月8日にGDP（1Q）の公表などがあり、海外では、7日に米貿易収支（4月）の公表、8日にはユーロ圏GDP（1Q）の公表などが予定されている。

[無担保コールレート]

	予想レンジ (%)
O/N	▲0.087 ~ 0.001
1M	▲0.020 ~ 0.020
2M	0.010 ~ 0.050
3M	0.000 ~ 0.130
6M	0.000 ~ 0.150

[オープン市場]

	予想レンジ (%)
現先 (on/1w)	▲0.050 ~ 0.000
CP 3M	0.000 ~ 0.01

<レポ>

足許GCは週初▲0.15%から出合い始め、月末跨ぎの取引となる30日には▲0.20%まで低下した。その後は▲0.15%～▲0.12%のレンジで推移し、短国の入札があった2日の取引では一時▲0.09%近辺まで上昇した。SC取引は2年438～448回債、5年149～158回債、10年350～370回債、20年180～184回債、30年65～78回債、40年13～15回債などに引合いが多く見られた。

<CP>

今週の入札発行総額は約1兆7,000億円で、週間償還額（約1兆4,600億円）を上回った。発行市場は、卸売や機械、石油製品等の幅広い業態で大型案件が見られ、活況なマーケットとなった。発行残高は先週末の24兆8,759億円から1日時点で25兆4,060億円と増加した。発行レートは0%から小幅なプラス圏での出合いが中心であった。

来週の週間償還額は、約4,000億円となっている。発行市場は、5・10日発行が予定されるため、活況な取引が見込まれる。発行レートは、0%近辺での出合いが中心となることを予想する。8日に、CP等買入れオペが4,000億円でオファーされる予定となっている。

<TDB>

6月2日の3M（1160回債）の入札は、最高落札利回り▲0.1603%（前回債▲0.1643%）、平均落札利回り▲0.1703%（前回債▲0.1792%）となった。

来週は8日に6M,9日に3Mの入札が予定されている。