



<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				
6/2 (月)	+ 300	▲ 36,700	▲ 36,400	国庫短期証券発行償還 (3M) 国債発行償還 (2年)	国債補充供給 + 700 成長基盤 ▲ 2,100 社債等買入 ▲ 100		米：パウエルFRB議長がFRBの会議で開会挨拶 欧：ユーロ圏製造業PMI (5月)
6/3 (火)	+ 1,000	▲ 60,000	▲ 59,000	法人税、消費税、保険掛け 一部前倒し			日：植田総裁が内外情勢調査会全国懇談会で講演 欧：ユーロ圏CPI (5月)
6/4 (水)	トン	▲ 55,000	▲ 55,000	法人税、消費税、保険掛け 普通交付税 国債発行 (10年)			米：ベージュブック公表 欧：ユーロ圏サービス業・総合PMI (5月)
6/5 (木)	トン	+ 2,000	+ 2,000				米：クワグラーFRB理事、講演 欧：ECB政策金利発表、ラガルド総裁記者会見 ユーロ圏PPI (5月)
6/6 (金)	+ 1,000	▲ 9,000	▲ 8,000	国債発行 (30年)			日：コール市場残高 (5月) 米：雇用統計 (5月) 欧：ユーロ圏GDP (1Q)

<インターバンク>

日銀当座預金残高は週初、前営業日対比1兆1,600億円増加の532兆7,400億円から始まった。その後、国債買入オペや国債発行等の要因により増減し、30日は532兆2,800億円 (速報) で越えた。
無担保コールON物加重平均金利は週初、0.476%から始まり、その後も横ばい圏で推移した。
ターム物は1W~3W物0.478%~0.610%のレンジ、1M~3M物0.59%~0.70%のレンジで出合が見られた。
来週の予定は、国内では、3日に日銀植田総裁が内外情勢調査会全国懇談会で講演。海外では4日に米ベージュブックの公表、5日にECB政策金利発表とラガルド総裁の記者会見、6日に米雇用統計 (5月) の公表などがある。

[無担保コールレート]

	予想レンジ (%)
O/N	0.450 ~ 0.478
1M	0.53 ~ 0.70
2M	0.55 ~ 0.75
3M	0.58 ~ 0.75
6M	0.65 ~ 0.80

<レポ>

足許GC取引は週央まで+0.49%前後での出合いが中心となった。
月末をまたぐ29日には一時+0.46%付近まで低下したものの、引けにかけては再び+0.49%前後まで上昇し、週末も同水準を維持した。SC取引は2年460~468回債、5年155~177回債、10年355~370、378回債、20年110~130回債などに引合いが見られた。

[オープン市場]

	予想レンジ (%)
現先 (on/1w)	0.40%台
CP 3M	0.55 ~ 0.60

<CP>

今週の入札発行総額は約2兆9,100億円で、週間償還額の2兆2,300億円を上回った。発行残高は先週末時点の23兆5,632億円から、5月29日時点で23兆7,955億円に増加した。発行市場は、食料品、電気機器、不動産業、その他金融業で大型の発行案件が見られた。入札案件の発行レートは、日銀の利上げ観測後退から、特に1か月物を中心にレートが低下した。a-1格相当の1か月物では、政策金利に限りなく近い0.50%台前半での出合い、3か月物では0.50%台半ばから0.60%近辺となった。
来週の償還額は9,300億円となっている。発行市場は、月初で償還見合いの落ち着いたマーケットが見込まれる。発行レートは、今週に引き続き、1か月物に関しては政策金利に限りなく近い0.50%台前半での出合い、3か月物に関しては0.50%台半ばから0.60%近辺と、横ばい圏での出合いを予想する。

<TDB>

30日の3M (1309回債) の入札は、最高落札利回り0.4276% (前回債0.3934%)、平均落札利回り0.4083% (前回債0.3818%) となった。
来週の入札は6日に3Mの入札が予定されている。