



短期市場の推移

[億円] [%]

	5月29日	5月30日	6月2日	6月3日
加重平均金利	0.476	0.476	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.467	0.491	0.494	0.494
無コール残	85,468	84,058	84,053	83,706
ON	36,439	35,619	34,934	34,827
その他	49,029	48,439	49,119	48,879
有コール残	30,769	30,246	31,270	30,962

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

※加重平均金利は無担保コールONのもの、無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボ レート
O/N	0.450	0.478	0.477	0.495
T/N	-	-	-	0.492
S/N	-	-	-	-
1W	0.482	0.610	0.517	0.479
2W	-	-	-	0.477
3W	-	-	-	0.475
1M	-	-	0.550	0.475
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.484
6M	-	-	-	0.500
1Y	-	-	-	0.572

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

6月5日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		(米) 4月の貿易収支		
	-		(欧) ECB理事会		
	-		-		

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月4日	6月5日	6月5日	6月6日	6月6日	6月6日
券		+600		+400		+0
財政		▲33,800		+1,500		▲9,000
過不足		▲33,200		+1,900		▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入				+7,800		
社債等買入	▲300					
国債補完供給	+1,800	▲1,600	+1,600			
当座預金増減		▲33,300		+11,300		▲9,000
当座預金残高		5,187,100		5,198,400		5,189,400
準備預金残高		4,711,100				
積み終了先		4,710,600				
超過準備		4,710,600				
非準備先残高		476,000				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		64.5%				
乖離率		35.4%				

6月4日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(6/5~)						
~1年	1,000	4,795	1,000	0.020	0.021	
1~3年	2,750	5,778	2,752	0.010	0.012	54.8
3~5年	2,750	8,809	2,756	0.012	0.015	24.4
10~25年	1,350	3,831	1,351	0.021	0.023	51.6
国債補完供給(6/4~6/5)						
	1,626	1,626	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

6月3日時点 6,438,800

所要

今積期の所要準備額 4,107,900

6月5日以降の残り所要

積数 2,700

平均 200

国庫短期証券入札予定

6月6日	3ヶ月(第1310回)
6月9日	6ヶ月(第1311回)
6月13日	3ヶ月
6月19日	1年

国債入札予定

6月5日	30年
6月19日	5年
6月24日	20年
6月26日	2年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日				直近日	残り回数
1年以下	1000	1,000	4				6月4日	0
1年超3年以下	2750	2,750	4	9	13	20	6月4日	3
3年超5年以下	2750	2,750	4	9	13	25	6月4日	3
5年超10年以下	3000	3,000	9	13	20	25	5月29日	4
10年超25年以下	1350	1,350	4	13	20		6月4日	2
25年超	750	750	9	25			5月19日	2
物価連動債	500	500	25				5月29日	1
変動利付債	-	300					4月14日	-

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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会