



短期市場の推移

	5月30日	6月2日	6月3日	6月4日
加重平均金利	0.476	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.491	0.494	0.494	0.492
無コール残	84,058	84,053	83,706	82,454
ON	35,619	34,934	34,827	33,665
その他	48,439	49,119	48,879	48,789
有コール残	30,246	31,270	30,962	30,869

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	0.487
T/N	-	-	-	0.480
S/N	-	-	-	-
1W	0.482	0.590	0.543	0.478
2W	-	-	0.525	0.478
3W	-	-	0.535	0.475
1M	-	-	0.560	0.475
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.595	0.483
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6日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
15:00	コール市場残高(5月)			(米) 5月の雇用統計	
	-			(欧) 1~3月のGDP(確報値)	
	-			-	

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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月5日	6月6日	6月6日	6月9日	6月9日
券	+400	+600	+600	+1,000	+1,000
財政	+300	▲4,900	▲4,900	▲2,000	▲2,000
過不足	+700	▲4,300	▲4,300	▲1,000	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+7,800			
CP等買入			▲200		
社債等買入			▲600		
国債補充供給	+1,600	▲400	+400		
当座預金増減	+9,700	▲4,700	▲4,700	▲1,000	▲1,000
当座預金残高	5,196,800	5,192,100	5,192,100	5,191,100	5,191,100
準備預金残高	4,723,400				
積み終了先	4,722,800		国債発行(30年)	国庫短期証券発行償還	
超過準備	4,722,800			(3M)	
非準備先残高	473,400				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	67.7%				
乖離率	32.2%				

6月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(6/5~6/6)	456	456	0.250	0.250		
	0	0				

マナリーベース [億円] 所要 [億円]
 6月4日時点 6,405,000 今積期の所要準備額 4,107,900
 6月6日以降の残り所要 積数 2,000
 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
6月19日	5年
6月24日	20年
6月26日	2年
7月1日	10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