



<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				
6/9 (月)	+ 300	+ 4,500	+ 4,800	国庫短期証券発行償還 (3M)	国債補完供給 社債等買入 CP等買入	+ 400 ▲ 100 ▲ 100	日: GDP (1-3月改定値) 経常収支 (4月) 貿易収支 (4月)
6/10 (火)	トン	+ 1,000	+ 1,000	国庫短期証券発行償還 (6M)			
6/11 (水)	トン	▲ 6,000	▲ 6,000	流動性供給	共通担保	▲ 8,000	米: CPI (5月)
6/12 (木)	トン	▲ 5,000	▲ 5,000	源泉税揚げ			米: PPI (5月)
6/13 (金)	トン	+ 84,000	+ 84,000	年金定時払い 流動性供給			日: 鉱工業生産 (4月) 欧: 鉱工業生産 (4月)

<インターバンク>

日銀当座預金残高は週初、前営業日対比5兆4,800億円減少の526兆8,000億円から始まった。その後、消費税・法人税・保険料揚げや国債発行等の要因により減少し、6日は518兆9,800億円（速報）で越過した。
無担保コールON物加重平均金利は週初、0.477%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0.483%～0.610%のレンジ、1M～3M物0.54%～0.595%のレンジで出が見られた。
来週の予定は、国内では、9日にGDP（1-3月改定値）の公表、海外では11日に米国CPI（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

<レボ>

足許GC取引は週央まで+0.49%近辺の出合いが中心となった。5日の取引では、レートは低下し+0.48%近辺が出合いの中心となった。短国3Mの発行日となる6日の取引は、0.48%～0.49%の狭いレンジで取引された。
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7,100億円で、週間償還額の9,100億円を下回った。発行残高は先週末時点の23兆8,526億円から、6月5日時点で24兆2,848億円に増加した。
発行市場は、月初で落ち着いたマーケットであったものの、鉄鋼、石油製品、卸売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、先月下旬に引き続き、特に1か月物を中心に投資家の購入意欲が強く、a-1格相当の1か月物では、政策金利に近い0.50%台前半での出合い、3か月物は案件が少なく、0.60%近辺での出合いが見られた。
来週の償還額は1兆600億円となっている。発行市場は、償還見合いの堅調な発行が見込まれる。発行レートは、今週に引き続き、1か月物では政策金利に近い0.50%台前半での出合い、3か月物では0.50%台後半から0.60%近辺での出合いを予想する。

<TDB>

6日の3M（1310回債）の入札は、最高落札利回り0.4698%（前回債0.4276%）、平均落札利回り0.4529%（前回債0.4083%）となった。
来週の入札は9日に6M、13日に3Mの入札が予定されている。