



<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				
6/1 (月)	+ 500	▲ 46,800	▲ 46,300	国庫短期証券発行償還 (3M) 国債発行償還 (2年)	社債等買入 ▲100		日: 設備投資(前年比) 米: ISM製造業景況指数(5月) 欧: ユーロ圏失業率(4月)
6/2 (火)	トン	▲ 40,000	▲ 40,000				
6/3 (水)	トン	▲ 26,000	▲ 26,000	法人税、消費税、保険揚げ 普通交付税 国債発行 (10年)			日: 植田日銀総裁がきさらぎ会で講演 米: ベージュブックの公表 ISM非製造業総合景況指数(5月)
6/4 (木)	トン	+ 1,500	+ 1,500				欧: ユーロ圏小売売上高(4月)
6/5 (金)	トン	▲ 2,500	▲ 2,500	流動性供給			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4,900億円増加の451兆9,100億円から始まった。その後、国債買入オペや国債発行償還等の要因により増減し、29日は452兆1,300億円(速報)で越えた。

無担保コールON物加重平均金利は、週を通して0.727%と横ばいで推移した。

ターム物は1W~3W物0.731%~0.900%のレンジ、1M~3M物0.885%~1.090%のレンジで出が見られた。

来週の予定は、国内では1日に設備投資(前年比)、3日にきさらぎ会で植田総裁の講演、海外では1日に米ISM製造業景況指数(5月)、ユーロ圏失業率(4月)、3日に地区連銀経済報告(ベージュブック)、ISM非製造業総合景況指数(5月)、4日にユーロ圏小売売上高(4月)、5日にユーロ圏GDP(1Q)の公表などがある。

[無担保コールレート]

	予想レンジ (%)
O/N	0.700 ~ 0.728
1M	0.88 ~ 1.05
2M	0.95 ~ 1.10
3M	1.05 ~ 1.15
6M	1.20 ~ 1.40

<レポ>

足許GCは週を通して0.75%~0.755%の狭いレンジでの出合いとなった。買入れオペや短国の発行の影響もほとんど見られず、水準に変化はなかった。

SC取引は2年470~482回債、5年155~184回債、10年356~372、378~381回債、20年110~130回債、30年86~89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)	0.70台
CP 3M	1.0 ~ 1.2

<CP>

今週の入札発行総額は4兆82億円で、週間償還額の3兆1,420億円を大幅に上回った。発行残高は、先週末時点の24兆1,642億円から、5月28日時点で24兆7,291億円へと増加した。発行市場では、不動産業・食料品・機械をはじめとする幅広い業種で、大型の発行案件が見られた。入札案件の発行レートは、a-1格相当の1か月物で0.8%台から1.0%程度、3ヶ月物で1.0%台から1.3%程度と、幅広い水準での取引が確認された。

来週の償還額は、約7,000億円となっている。発行市場は、月初で新規の発行は少なく、償還と同額程度の落ち着いたマーケットが見込まれる。発行レートは、次回の利上げ時期を見極めようとする動きから、引き続き水準を探る展開となるだろう。

<TDB>

29日の3M(第1383回債)の入札は、最高落札利回り0.8964%(前回債0.8904%)、平均落札利回り0.8835%(前回債0.8839%)となった。来週の入札は6月5日に3Mが予定されている。