



短期市場の推移

	5月27日	5月28日	5月29日	6月1日
加重平均金利	0.727	0.727	0.727	0.726
東京レボレート(TN)	0.754	0.750	0.755	0.755
無コール残	87,168	92,465	84,240	88,587
ON	30,399	35,216	30,311	33,203
その他	56,769	57,249	53,929	55,384
有コール残	23,483	24,281	23,559	24,618

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	0.700	0.780	0.727	0.751
T/N	-	-	-	0.755
S/N	-	-	-	-
1W	0.734	0.830	0.754	0.752
2W	-	-	-	0.752
3W	-	-	-	0.791
1M	-	-	-	0.855
2M	-	-	-	-
3M	1.080	1.120	1.107	0.933
6M	-	-	-	0.976
1Y	-	-	-	1.118

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3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (6月見込み)		(米) サービス業PMI (5月)	
17:30	植田日銀総裁の講演 (きらさぎ会)		(米) ADP雇用統計 (4月)	
	-		(欧) サービス業PMI (5月)	

本日の市況

無担保コールON物は0.727%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)は前営業対比+0.001%の0.727%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

翌営業日のマーケット

出合い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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月2日	6月3日	6月3日	6月4日	6月4日	6月4日
券		+800	▲100			+0
財政		▲62,100	▲28,800			+1,500
過不足		▲61,300	▲28,900			+1,500
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
国債補充供給	+1,200	▲400	+400			
社債等買入			▲500			
成長基盤強化支援資金供給			▲2,600			
当座預金増減		▲60,500	▲31,600			+1,500
当座預金残高		4,404,700	4,373,100			4,374,600
準備預金残高		4,101,600	主な需給要因			
積み終了先		4,100,900	法人税、消費税、保険			
超過準備		4,100,900	揚げ			
非準備先残高		303,100	普通交付税			
準備預金進捗率		99.9%	国債発行 (10年)			
平均		58.1%				
乖離率		41.8%				

6月2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(6/2~6/3)	414	414	0.550	0.550		
米ドル資金供給(6/4~6/11)	0	0				

マネタリーベース [億円]
6月1日時点 5,662,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,197,500
6月3日以降の残り所要	
積数	1,500
平均	100

国庫短期証券入札予定

6月5日	3ヶ月(第1385回)
6月9日	6ヶ月(第1386回)
6月12日	3ヶ月
6月18日	1年
国債入札予定	
6月10日	30年
6月23日	5年
6月25日	20年
6月30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	3		5月11日 1
1年超3年以下	2550	2,550	11 18 26		5月21日 3
3年超5年以下	2300	2,300	3 11 18		5月28日 3
5年超10年以下	2400	2,400	11 18 26		5月28日 3
10年超25年以下	800	800	3 11 18		5月28日 3
25年超	750	750	3 26		5月21日 2
物価連動債	400	400	26		5月28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