



### 短期市場の推移

	[億円] [%]			
	5月27日	5月28日	5月29日	5月30日
加重平均金利	0.078	0.077	0.078	0.077
東京レポレート(TN)	0.048	0.041	0.051	0.033
無コール残	75,707	74,804	76,749	76,284
ON	32,154	31,234	33,079	32,344
その他	43,553	43,570	43,670	43,940
有コール残	38,996	38,852	39,806	39,471

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.060	0.079	0.077	0.018
T/N	-	-	-	0.071
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.056
2W	-	-	0.170	0.058
3W	-	-	-	0.057
1M	-	-	0.220	0.057
2M	-	-	0.210	-
3M	-	-	-	0.085
6M	-	-	-	0.127
1Y	-	-	-	0.200

無担保コール(速報)は日銀、東京レポ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
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節 (5月実績)		(米) 5月の製造業PMI (確報)	
16:00	24年5月調査の債券市場サーベイ		(米) 5月のISM製造業指数	
			(欧) 1-0圏 5月の製造業PMI (確報)	

### 本日の市況

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後も主に0.075%~0.078%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.077%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

### 資金需給

	[億円]		
	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月31日	6月3日	6月4日
券	+400	+900	+0
財政	▲9,500	▲64,600	▲50,000
過不足	▲9,100	▲63,700	▲50,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			▲10,900
CP等買入	▲2,300	+3,000	
社債等買入		▲100	
国債補完供給	+30,300	▲27,800	+27,800
成長基盤強化支援		▲1,600	
当座預金増減	▲5,900	▲26,700	▲50,000
当座預金残高	5,515,300	5,488,600	5,438,600
準備預金残高	4,848,000	主な需給要因	
積み終了先	4,847,400	法人税、消費税、保	法人税、消費税、保
超過準備	4,847,400	険揚げ(前倒し)	険揚げ
非準備先残高	667,300	国庫短期証券発行償	普通交付税
準備預金進捗率	99.9%	還(3M)	
平均	58.1%	国債発行償還(2年)	
乖離率	41.8%		

### 5月31日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(6/3~)						
3~5年	4,250	9,930	4,256	0.000	0.000	98.7
5~10年	4,250	9,879	4,257	0.003	0.007	32.0
10~25年	1,500	3,751	1,504	0.021	0.022	32.9
25年~	750	2,303	754	0.030	0.031	5.2
物価連動	600	2,671	601	▲0.070	▲0.192	6.0
国債補完供給(5/31~6/3)						
	28,611	28,611	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

### マネタリーベース [億円]

5月30日時点 6,763,500

### 所要

今積期の所要準備額	4,079,800
6月3日以降の残り所要	
積数	3,300
平均	300

### 国庫短期証券入札予定

6月6日	6ヶ月(第1235回)
6月7日	3ヶ月(第1236回)
6月13日	3ヶ月
6月19日	1年

### 国債入札予定

6月4日	10年
6月6日	30年
6月20日	5年
6月25日	20年

### 来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	1500	1,500	月1回	5月7日	1
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	7 12 18 24	5月23日	4
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	12 18 24 28	5月31日	4
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	7 12 18 24	5月31日	4
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	7 18 28	5月31日	3
25年超	500~1,000	750	12 28	5月31日	2
物価連動債	600	600	月1回	5月31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