

UEDA YAGI MONTHLY DATA
 — 資金需給動向とONレートの足どり・主要諸指標 上田八木短資株式会社 —

<平成 26年 (2014年) 8月>

平成 26年 9月 1日
 利率: %

*速報ベース			資金過不足			オベラント			オベスタート				注1) 日銀当預・準備預金(後半所要 61,300)				注2) T B		注4) ユーロ円		注5) 新発		東証		注6) 金額単位: 億円	
平成26年8月	加重平均	最低最高	銀行券	財政等	過不足戻	貸出	CP・国債 手形・共通担保資金供給オペ	計(△)	貸出	手形・共通担保資金供給オペ	CP・国債 国庫短期証券・企業金融支援	計	日銀当預 増減	日銀当預 残高	準備預金 残高	積終了先	3ヵ月	3ヵ月	金利先物 3ヵ月	10年 国債	平均 株価	一部 出来高	為替 円相場			
1	金	0.068	0.135	△ 500	△ 1,300	△ 1,800	共通担保(全店) △ 10,400	△ 10,400	共通担保(全店) + 12,900	国債買入 + 6,400	+ 19,300	+ 7,100	+ 1,527,700	+ 1,399,900	+ 1,183,600	0.026	0.21000	0.195	0.530	15,523.11	22.45	102.75	102.99			
4	月	0.067	0.135	+ 1,300	△ 44,200	△ 42,900	共通担保(全店) △ 4,900	△ 4,900	共通担保(全店) + 2,900		+ 2,900	△ 44,900	+ 1,482,800	+ 1,356,700	+ 1,141,500	0.025	0.21000	0.195	0.525	15,474.50	19.21	102.48	102.73			
5	火	0.072	0.135	+ 1,000	+ 6,400	+ 7,400	CP等買入 △ 500	△ 500		国庫短期証券買入 + 30,000	+ 35,100	+ 42,000	+ 1,524,800	+ 1,399,600	+ 1,188,100	0.023	0.21000	0.200	0.515	15,320.31	22.06	102.46	102.63			
6	水	0.069	0.135	+ 900	△ 1,400	△ 500	CP等買入 △ 100	△ 100		ETF買入 + 100	+ 6,500	+ 5,900	+ 1,530,700	+ 1,399,800	+ 1,188,700	0.021	0.21000	0.200	0.515	15,159.79	21.19	102.50	102.64			
7	木	0.070	0.135	△ 300	△ 26,700	△ 27,000	社債等買入 △ 200 CP等買入 △ 600	△ 800		ETF買入 + 100	+ 100	△ 27,700	+ 1,503,000	+ 1,375,800	+ 1,165,100	0.022	0.21000	0.200	0.525	15,232.37	22.10	102.04	102.46			
8	金	0.068	0.135	△ 600	+ 2,400	+ 1,800	CP等買入 △ 400	△ 400		ETF買入 + 100 CP等買入 + 4,300	+ 9,900	+ 11,300	+ 1,514,300	+ 1,393,300	+ 1,183,500	0.023	0.21000	0.200	0.505	14,778.37	27.54	101.51	102.15			
11	月	0.066	0.135	+ 1,000	△ 42,600	△ 41,600	社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 300 共通担保(全店) △ 5,000	△ 5,400	共通担保(全店) + 4,000	国債補完供給 △ 100	+ 4,100	△ 42,900	+ 1,471,400	+ 1,350,000	+ 1,140,500	0.021	0.21000	0.200	0.510	15,130.52	18.74	102.02	102.20			
12	火	0.067	0.125	+ 200	+ 2,400	+ 2,600	国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 400	△ 300		ETF買入 + 100	+ 100	+ 2,400	+ 1,473,800	+ 1,349,400	+ 1,141,800	0.020	0.21000	0.200	0.505	15,161.31	16.18	102.20	102.37			
13	水	0.067	0.135	△ 300	△ 7,400	△ 7,700	CP等買入 △ 200	△ 200		ETF買入 + 100 国庫短期証券買入 + 25,000	+ 34,200	+ 26,300	+ 1,500,100	+ 1,370,400	+ 1,164,500	0.019	0.21000	0.200	0.505	15,213.63	17.37	102.23	102.48			
14	木	0.068	0.135	△ 1,200	△ 4,000	△ 5,200	CP等買入 △ 400	△ 400		ETF買入 + 100	+ 100	△ 5,500	+ 1,494,600	+ 1,369,400	+ 1,161,800	0.019	0.21000	0.200	0.500	15,314.57	18.37	102.40	102.66			
15	金	0.068	0.135	△ 900	+ 39,600	+ 38,700	CP等買入 △ 700	△ 700		社債等買入 + 1,000 国債買入 + 2,500	+ 3,500	+ 41,500	+ 1,536,100	+ 1,399,800	+ 1,177,300	0.025	0.21000	0.205	0.500	15,318.34	15.79	102.46	102.56			
18	月	0.066	0.135	+ 1,200	△ 39,600	△ 38,400	CP等買入 △ 100 共通担保(全店) △ 3,900	△ 4,000	共通担保(全店) + 4,800	ETF買入 + 100	+ 4,900	△ 37,500	+ 1,498,600	+ 1,363,600	+ 1,084,800	0.024	0.21000	0.205	0.495	15,322.60	15.52	102.25	102.49			
19	火	0.067	0.135	+ 700	+ 0	+ 700	CP等買入 △ 300	△ 300		国庫短期証券買入 + 20,000 国債買入 + 9,200	+ 29,200	+ 29,600	+ 1,528,200	+ 1,392,100	+ 1,116,800	0.024	0.21000	0.205	0.495	15,449.79	17.97	102.53	102.65			
20	水	0.073	0.135	+ 100	△ 16,500	△ 16,400	CP等買入 △ 600	△ 600				△ 17,000	+ 1,511,200	+ 1,372,000	+ 1,109,800	0.025	0.21000	0.205	0.510	15,454.45	18.32	102.91	103.34			
21	木	0.067	0.135	△ 1,300	△ 13,500	△ 14,800	CP等買入 △ 500	△ 500		CP等買入 + 4,400	+ 4,400	△ 10,900	+ 1,500,300	+ 1,363,500	+ 1,107,200	0.026	0.21000	0.205	0.525	15,586.20	20.94	103.68	103.96			
22	金	0.068	0.135	△ 2,000	△ 2,200	△ 4,200	CP等買入 △ 700	△ 700		国債買入 + 6,400	+ 6,400	+ 1,500	+ 1,501,800	+ 1,363,600	+ 1,126,700	0.031	0.21000	0.200	0.505	15,539.19	17.57	103.68	103.95			
25	月	0.068	0.135	+ 100	△ 21,400	△ 21,300	社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 900 共通担保(全店) △ 3,400	△ 4,400	共通担保(全店) + 4,000		+ 4,000	△ 21,700	+ 1,480,100	+ 1,350,600	+ 1,115,600	0.031	0.21000	0.200	0.505	15,613.25	15.63	104.09	104.27			
26	火	0.071	0.135	+ 100	+ 9,400	+ 9,500	社債等買入 △ 200 CP等買入 △ 400	△ 600		国債補完供給 △ 100 国庫短期証券買入 + 30,000 国債買入 + 9,200	+ 39,100	+ 48,000	+ 1,528,100	+ 1,395,900	+ 1,163,900	0.031	0.21000	0.200	0.495	15,521.22	18.23	104.27	104.12			
27	水	0.067	0.135	△ 400	+ 1,400	+ 1,000	国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 500	△ 400		国債補完供給 △ 200	△ 200	+ 400	+ 1,528,500	+ 1,391,700	+ 1,161,800	0.031	0.21000	0.200	0.490	15,534.82	20.51	103.89	104.16			
28	木	0.074	0.135	△ 1,600	△ 5,600	△ 7,200	国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 400	△ 200		CP等買入 + 4,100	+ 4,100	△ 3,300	+ 1,525,200	+ 1,381,000	+ 1,157,100	0.033	0.21000	0.200	0.485	15,459.86	20.30	103.68	103.92			
29	金	0.070	0.135	△ 600	+ 600	+ 0	被災地金融機関支援 △ 600 CP等買入 △ 4,000 共通担保(全店) △ 12,100	△ 16,700	共通担保(全店) + 6,100	被災地金融機関支援 + 500 国債買入 + 5,500	+ 12,100	△ 4,600	+ 1,520,600	+ 1,389,000	+ 1,166,900	0.024	0.21000	0.200	0.490	15,424.59	20.59	103.66	103.86			
中 平 均	0.0686		月中実績 △ 3,059	月中実績 △ 164,410	月中実績 △ 167,469		国債買入 + 65,388		月中実績 + 0	月中実績 △ 4,937		月中実績 △ 2,961		前月末比 △ 39			0.025	0.21000	0.201	0.506	15,358.70	19.36	102.95			
中 平 均*	0.0686		月末残高 868,339				国庫短期証券買入 + 105,003		月末残高 + 46	月末残高 + 99,661																

*暦日ベース 基準貸付金利 { 0.75 % (H19. 2.21~) 短期プライム 1.475 % (H21.1.13~) 注1) 日本銀行発表
 0.50 % (H20. 10.31~) 長期プライム { 1.20 % (H26.2.12~) 注2) TB468~TB476回債(日本相互証券)日本経済新聞
 0.30 % (H20. 12.19~) 1.15 % (H26.7.10~) 注3) TIBOR(東京銀行間取引金利)日本経済新聞
 注4) 中心限月 金利換算値 公式終値 日本経済新聞
 注5) 334回債(日本相互証券)日本経済新聞
 注6) 上段は高値、下段は安値 日本経済新聞