

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) 11月>

平成26年12月1日

利率: %

平成26年11月	*速報ベース		資金過不足			オベエンド			オベスタート			注1) 日銀当預・準備預金(後半所要 62,500)				注2) T B 3ヵ月		注4) ユーロ円 金利先物 3ヵ月		注5) 新発 10年 国債		東証 平均 株価		東証 一部 出来高		注6) 為替 円相場
	無担	ON*	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	▲	0.002	0.18400	0.150	0.438	16,862.47	
4	火	0.061	0.135	+ 800	△ 20,500	△ 19,700			国債補完供給 + 200							△ 21,000	+ 1,656,000	+ 1,517,000	+ 1,248,800	0.003	0.18800	0.150	0.438	16,862.47	52.08	113.28
5	水	0.061	0.135	+ 1,300	+ 4,800	+ 6,100			CP等買入 △ 200							+ 700	+ 1,656,700	+ 1,516,200	+ 1,250,100	0.004	0.18500	0.155	0.464	16,937.32	34.57	113.42
6	木	0.061	0.135	+ 200	+ 700	+ 900			共通担保(全店) △ 2,900	△ 2,900						+ 38,400	+ 1,695,100	+ 1,546,400	+ 1,280,900	0.008	0.18400	0.160	0.465	16,792.48	31.86	114.06
7	金	0.062	0.135	+ 200	△ 22,200	△ 22,000			国債補完供給 + 200							△ 19,700	+ 1,675,400	+ 1,540,200	+ 1,276,100	0.001	0.18400	0.160	0.470	16,880.38	24.88	115.53
10	月	0.068	0.135	+ 1,100	△ 33,900	△ 32,800			ETF買入 △ 100							△ 19,700	+ 1,655,700	+ 1,514,700	+ 1,251,400	▲ 0.002	0.18400	0.160	0.454	16,780.53	20.53	114.46
11	火	0.068	0.135	+ 800	△ 3,200	△ 2,400			社債等買入 △ 300							+ 25,100	+ 1,680,800	+ 1,537,300	+ 1,275,200	▲ 0.004	0.18400	0.165	0.480	17,124.11	24.12	113.86
12	水	0.065	0.135	+ 600	△ 1,100	△ 500			共通担保(全店) △ 4,000	△ 4,200						+ 18,300	+ 1,699,100	+ 1,545,700	+ 1,284,900	▲ 0.005	0.18400	0.175	0.520	17,197.05	31.20	115.86
13	木	0.063	0.135	△ 300	△ 5,300	△ 5,600			CP等買入 △ 100	△ 200						△ 5,700	+ 1,693,400	+ 1,548,200	+ 1,287,300	▲ 0.003	0.18400	0.170	0.495	17,392.79	24.67	115.10
14	金	0.066	0.135	△ 400	+ 3,200	+ 2,800			CP等買入 △ 100	△ 200						+ 10,100	+ 1,703,500	+ 1,553,500	+ 1,294,700	▲ 0.057	0.18300	0.165	0.475	17,490.83	29.54	116.01
17	月	0.064	0.135	+ 1,200	△ 61,600	△ 60,400			共通担保(全店) △ 4,800	△ 5,200						△ 62,200	+ 1,641,300	+ 1,504,800	+ 967,600	▲ 0.058	0.18300	0.160	0.470	16,973.80	28.89	115.43
18	火	0.065	0.125	+ 100	△ 400	△ 300			CP等買入 △ 100	△ 100						+ 28,900	+ 1,670,200	+ 1,536,200	+ 1,228,200	▲ 0.065	0.18300	0.160	0.500	17,344.06	25.62	115.72
19	水	0.065	0.125	△ 500	△ 2,900	△ 3,400			社債等買入 △ 100	△ 500						+ 1,500	+ 1,671,700	+ 1,530,800	+ 1,233,900	▲ 0.077	0.18300	0.155	0.470	17,288.75	27.66	116.83
20	木	0.066	0.135	△ 2,500	△ 23,900	△ 26,400			CP等買入 △ 100	△ 1,000						△ 23,400	+ 1,648,300	+ 1,496,800	+ 1,219,100	▲ 0.085	0.18300	0.150	0.465	17,300.86	24.53	117.44
21	金	0.069	0.135	△ 2,700	+ 6,000	+ 3,300			CP等買入 △ 400	△ 500						+ 3,200	+ 1,651,500	+ 1,507,200	+ 1,256,400	▲ 0.024	0.18200	0.155	0.455	17,357.51	25.17	117.89
25	火	0.065	0.135	△ 300	△ 4,300	△ 4,600			CP等買入 △ 1,000	△ 5,000						+ 5,500	+ 1,657,000	+ 1,513,600	+ 1,264,000	▲ 0.024	0.18200	0.160	0.445	17,407.62	27.16	118.98
26	水	0.066	0.135	△ 900	△ 1,000	△ 1,900			共通担保(本店) △ 4,000	△ 5,000						+ 31,300	+ 1,688,300	+ 1,542,500	+ 1,294,700	▲ 0.024	0.18200	0.155	0.430	17,383.58	22.11	117.36
27	木	0.066	0.125	△ 2,200	+ 900	△ 1,300			CP等買入 △ 500	△ 300						+ 9,900	+ 1,698,200	+ 1,550,600	+ 1,302,500	▲ 0.028	0.18200	0.155	0.420	17,248.50	20.57	118.37
28	金	0.067	0.135	△ 2,000	+ 5,800	+ 3,800			CP等買入 △ 3,200	△ 3,200						+ 4,600	+ 1,702,800	+ 1,561,100	+ 1,315,600	▲ 0.046	0.18200	0.160	0.415	17,459.85	23.29	117.69
月平均	0.0649	—	—	月中実績 △ 5,466	月中実績 △ 158,681	月中実績 △ 164,147	—	—	国債買入 + 106,596	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	▲ 0.027	0.18344	0.159	0.463	17,179.03	27.69	116.23
月平均*	0.0648	—	—	月末残高 1,702,818	—	—	—	—	国庫短期証券買入 + 87,510	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

*暦日ベース 基準貸付金利 { 0.75 % (H19. 2.21~) 短期 フ ラ イ ム { 1.475 % (H21.1.13~) 0.50 % (H20. 10.31~) 長期 フ ラ イ ム { 1.20 % (H26.2.12~) 0.30 % (H20. 12.19~) 1.15 % (H26.7.10~)

注1) 日本銀行発表 注2) TB490~TB496(日本相互証券) 日本経済新聞 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) 335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