

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 27年 (2015年) 2月>

平成 27年 3月 2日  
利率: %

— 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 —

| *速報ベース  |        |         | 資金過不足            |                   |                   | オベエンド |  |          | オベスタート    |                   |   |                 | 注1)      |               |             |             | 注2)     |                 | 注3)         |                 | 注4)            |                 | 注5)       |  | 注6) |  |
|---------|--------|---------|------------------|-------------------|-------------------|-------|--|----------|-----------|-------------------|---|-----------------|----------|---------------|-------------|-------------|---------|-----------------|-------------|-----------------|----------------|-----------------|-----------|--|-----|--|
| 平成27年2月 | 無担加重平均 | ON*最低最高 | 銀行券              | 財政等               | 過不足戻              | 貸出    | CP・国債<br>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<br>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        | T B 3ヵ月 | ユーロ円<br>注3) 3ヵ月 | 金利先物<br>3ヵ月 | 新発<br>10年<br>国債 | 東証<br>平均<br>株価 | 東証<br>一部<br>出来高 | 為替<br>円相場 |  |     |  |
|         |        | 0.060   |                  |                   |                   |       | 社債等買入 △ 100<br>CP買入等 △ 600<br>共通担保(全店) △ 1,600                 | △ 2,300  |           | 共通担保(全店) + 800    | ETF買入 + 400                                   | + 1,200         | △ 33,200 | + 1,816,100   | + 1,649,400 | + 1,352,600 | ▲ 0.008 | 0.17300         | 0.130       | 0.284           | 17,558.04      | 22.96           | 116.90    |  |     |  |
| 2月      | 0.071  | 0.135   | + 1,500          | △ 33,600          | △ 32,100          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.050   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 300  | △ 300    |           |                   | 国庫短期証券買入 + 25,000<br>国債買入 + 12,000            | + 37,000        | + 6,600  | + 1,822,700   | + 1,654,000 | + 1,358,800 | ▲ 0.014 | 0.17300         | 0.135       | 0.355           | 17,335.85      | 27.58           | 116.87    |  |     |  |
| 3火      | 0.073  | 0.135   | + 1,200          | △ 31,300          | △ 30,100          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.060   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 100  | △ 100    |           |                   | ETF買入 + 100<br>国債買入 + 4,900                   | + 5,000         | △ 21,900 | + 1,800,800   | + 1,630,000 | + 1,335,200 | ▲ 0.017 | 0.17300         | 0.140       | 0.375           | 17,678.74      | 27.27           | 117.43    |  |     |  |
| 4水      | 0.075  | 0.135   | + 1,100          | △ 27,900          | △ 26,800          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.060   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 400  | △ 400    |           |                   | ETF買入 + 100                                   | + 100           | △ 16,700 | + 1,784,100   | + 1,618,400 | + 1,326,300 | ▲ 0.016 | 0.17300         | 0.145       | 0.355           | 17,504.62      | 26.45           | 117.02    |  |     |  |
| 5木      | 0.076  | 0.135   | + 200            | △ 16,600          | △ 16,400          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.030   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 500<br>共通担保(全店) △ 10,000                               | △ 10,500 |           | 共通担保(全店) + 13,600 | ETF買入 + 300<br>国債買入 + 12,000                  | + 25,900        | + 12,700 | + 1,796,800   | + 1,632,700 | + 1,344,700 | 0.000   | 0.17300         | 0.135       | 0.336           | 17,648.50      | 22.12           | 117.22    |  |     |  |
| 6金      | 0.073  | 0.080   | + 200            | △ 2,900           | △ 2,700           |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.060   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 300<br>共通担保(全店) △ 2,400                                | △ 2,700  |           | 共通担保(全店) + 2,200  | ETF買入 + 300                                   | + 2,500         | △ 24,200 | + 1,772,600   | + 1,612,200 | + 1,319,500 | 0.000   | 0.17300         | 0.145       | 0.355           | 17,711.93      | 20.07           | 118.73    |  |     |  |
| 9月      | 0.081  | 0.130   | + 800            | △ 24,800          | △ 24,000          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.060   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 600  |          |           |                   | ETF買入 + 200<br>CP等買入 + 4,000                  |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
| 10火     | 0.074  | 0.125   | + 300            | △ 9,000           | △ 8,700           |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.050   |                  |                   |                   |       | 共通担保(全店) △ 4,700   | △ 5,300  |           | 共通担保(全店) + 3,600  | 国債買入 + 12,300                                 | + 20,100        | + 6,100  | + 1,778,700   | + 1,614,300 | + 1,329,200 | 0.000   | 0.17300         | 0.150       | 0.390           | 17,652.68      | 20.04           | 118.40    |  |     |  |
| 12木     | 0.074  | 0.130   | + 200            | △ 8,000           | △ 7,800           |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.060   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 400<br>共通担保(全店) △ 4,900                                | △ 5,300  |           | 共通担保(全店) + 3,900  | 国債買入 + 4,700<br>国庫短期証券買入 + 25,000             | + 29,700        | + 21,600 | + 1,800,300   | + 1,635,400 | + 1,349,100 | 0.001   | 0.17300         | 0.150       | 0.390           | 17,979.72      | 27.73           | 119.99    |  |     |  |
| 13金     | 0.073  | 0.125   | + 200            | + 64,700          | + 64,900          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.050   |                  |                   |                   |       | 国債補完供給 + 300<br>社債等買入 △ 100<br>CP等買入 △ 800<br>共通担保(全店) △ 3,400 | △ 4,000  |           | 共通担保(全店) + 1,800  | 国債補完供給 △ 300<br>ETF買入 + 600                   | + 4,200         | + 63,800 | + 1,864,100   | + 1,684,500 | + 1,385,100 | 0.001   | 0.17300         | 0.155       | 0.415           | 17,913.36      | 25.62           | 118.42    |  |     |  |
| 16月     | 0.075  | 0.130   | + 1,000          | △ 32,300          | △ 31,300          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.060   |                  |                   |                   |       | 国債補完供給 + 400<br>CP等買入 △ 200<br>共通担保(全店) △ 12,700               | △ 12,500 |           | 共通担保(全店) + 4,700  | 国債補完供給 △ 200<br>国庫短期証券買入 + 20,000             | + 24,500        | △ 7,600  | + 1,830,900   | + 1,662,500 | + 1,259,400 | 0.004   | 0.17300         | 0.145       | 0.390           | 17,987.09      | 23.16           | 118.78    |  |     |  |
| 17火     | 0.079  | 0.128   | + 0              | △ 19,600          | △ 19,600          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.050   |                  |                   |                   |       | 国債補完供給 + 200   |          |           |                   | ETF買入 + 200<br>社債等買入 + 1,000<br>国債買入 + 12,000 | + 13,200        | + 12,200 | + 1,843,100   | + 1,679,900 | + 1,314,300 | 0.004   | 0.17300         | 0.150       | 0.410           | 18,199.17      | 27.23           | 118.88    |  |     |  |
| 18水     | 0.077  | 0.130   | △ 400            | △ 600             | △ 1,000           |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.050   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 200  | △ 200    |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
| 19木     | 0.082  | 0.130   | △ 1,100          | △ 12,500          | △ 13,600          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.060   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 800<br>共通担保(全店) △ 12,800                               | △ 13,600 |           | 共通担保(全店) + 11,800 | CP等買入 + 4,000                                 | + 15,800        | △ 18,900 | + 1,810,400   | + 1,644,600 | + 1,331,400 | 0.000   | 0.17300         | 0.140       | 0.385           | 18,332.30      | 24.06           | 118.44    |  |     |  |
| 20金     | 0.075  | 0.130   | △ 1,300          | △ 19,800          | △ 21,100          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.050   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 400<br>共通担保(全店) △ 2,700                                | △ 3,100  |           | 共通担保(全店) + 2,500  | ETF買入 + 200                                   | + 2,700         | △ 19,300 | + 1,791,100   | + 1,625,300 | + 1,317,200 | ▲ 0.005 | 0.17300         | 0.145       | 0.380           | 18,466.92      | 24.91           | 118.82    |  |     |  |
| 23月     | 0.078  | 0.125   | △ 400            | △ 18,500          | △ 18,900          |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.050   |                  |                   |                   |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
| 24火     | 0.077  | 0.130   | △ 1,300          | + 4,000           | + 2,700           |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.030   |                  |                   |                   |       | 社債等買入 △ 300<br>CP等買入 △ 400                                     | △ 700    |           |                   | 国庫短期証券買入 + 25,000<br>国債買入 + 12,200            | + 37,200        | + 39,700 | + 1,830,800   | + 1,666,600 | + 1,360,000 | ▲ 0.007 | 0.17300         | 0.145       | 0.370           | 18,603.48      | 23.20           | 118.88    |  |     |  |
| 25水     | 0.086  | 0.130   | △ 1,400          | + 3,100           | + 1,700           |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.060   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 400  |          |           |                   | ETF買入 + 100<br>国債買入 + 5,500                   | + 5,600         | + 6,600  | + 1,837,400   | + 1,666,500 | + 1,361,700 | ▲ 0.009 | 0.17100         | 0.145       | 0.335           | 18,585.20      | 22.12           | 118.78    |  |     |  |
| 26木     | 0.075  | 0.130   | △ 2,300          | △ 3,800           | △ 6,100           |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.030   |                  |                   |                   |       | CP等買入 △ 600  | △ 600    |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
| 27金     | 0.074  | 0.130   | △ 2,000          | + 7,700           | + 5,700           |       |  |          |           |                   |   |                 |          |               |             |             |         |                 |             |                 |                |                 |           |  |     |  |
|         |        | 0.040   |                  |                   |                   |       | 社債等買入 △ 300<br>CP等買入 △ 3,800                                   | △ 4,100  |           |                   | CP等買入 + 4,000<br>国債買入 + 12,300                | + 16,300        | + 17,900 | + 1,848,600   | + 1,687,200 | + 1,386,400 | 0.000   | 0.17100         | 0.135       | 0.335           | 18,785.79      | 23.91           | 119.09    |  |     |  |
| 月平均     | 0.0762 | —       | -3454<br>△ 3,454 | 月中実績<br>△ 181,975 | 月中実績<br>△ 185,429 |       | 国債買入 + 95,907  | —        | 月中実績 + 0  | 月中実績<br>△ 10,349  |   | 月中実績<br>△ 6,189 | —        | 前月末比<br>△ 701 | —           | —           | ▲ 0.004 | 0.17268         | 0.143       | 0.370           | 18,053.20      | 24.57           | 118.55    |  |     |  |
| 月平均*    | 0.0753 | —       | 月末残高<br>893,759  | —                 | —                 |       | 国庫短期証券買入 + 95,010  | —        | 月末残高 + 46 | 月末残高<br>+ 65,630  |   | —               | —        | —             | —           | —           | —       | —               | —           | —               | —              | —               | —         |  |     |  |

\*暦日ベース

基準貸付金利

0.75 % (H19. 2.21~ )  
0.50 % (H20. 10.31~ )  
0.30 % (H20. 12.19~ )

短期プライム

1.475 % (H21.1.13~ )  
1.05 % (H26.12.10~ )  
1.15 % (H27.2.10~ )

注1) 日本銀行発表

注2) TB509~TB515回債(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) 337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