

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27年(2015年)5月>

平成27年6月1日
利率: %

*速報ベース			資金過不足			オペエンド			オバスタート				注1) 日銀当預・準備預金(後半所要 64,900)				注2) T B 3ヵ月		注4) ユーロ円 注3) 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) 金額単位: 億円 為替 円相場	
平成27年5月	無担 O N*	加重平均	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	T B 3ヵ月	ユーロ円 注3) 3ヵ月	金利先物 3ヵ月	新発 10年 国債	東証 平均 株価	東証 一部 出来高	為替 円相場	注6)				
1	金	0.068	△ 2,600	△ 10,200	△ 12,800		CP等買入 △ 100 国債補充供給 + 100	+ 0			ETF買入 + 300	+ 300	△ 12,500	+ 2,089,700	+ 1,894,800	+ 1,572,800	▲ 0.019	0.16900	0.150	0.360	19,531.63	22.31	119.41	119.85				
7	木	0.065	+ 4,200	△ 46,400	△ 42,200		CP等買入 △ 400 共通担保(全店) △ 800	△ 1,200		共通担保(全店) + 1,400		+ 1,400	△ 42,000	+ 2,047,700	+ 1,861,700	+ 1,541,200	▲ 0.019	0.16900	0.155	0.430	19,291.99	23.65	119.32	119.60				
8	金	0.068	+ 4,600	+ 1,300	+ 5,900		CP等買入 △ 400	△ 400			国庫短期証券買入 + 22,500 国債買入 + 8,200	+ 30,700	+ 36,200	+ 2,083,900	+ 1,896,200	+ 1,579,000	▲ 0.019	0.16900	0.150	0.410	19,379.19	25.65	119.70	120.06				
11	月	0.067	+ 3,600	△ 3,900	△ 300		CP等買入 △ 500 共通担保(全店) △ 2,200	△ 2,700		共通担保(全店) + 1,600	国債補充供給 △ 200 国債買入 + 8,000	+ 9,400	+ 6,400	+ 2,090,300	+ 1,903,700	+ 1,587,600	▲ 0.005	0.16900	0.145	0.390	19,620.91	28.93	119.72	119.99				
12	火	0.067	+ 3,000	△ 13,100	△ 10,100		国債補充供給 + 200 CP等買入 △ 300	△ 100			ETF買入 + 100	+ 100	△ 10,100	+ 2,080,200	+ 1,894,700	+ 1,580,800	▲ 0.005	0.16900	0.155	0.450	19,624.84	27.31	119.94	120.27				
13	水	0.068	+ 2,000	△ 1,000	+ 1,000		CP等買入 △ 500	△ 500			国債補充供給 △ 700 CP等買入 + 3,500 国庫短期証券買入 + 20,000 国債買入 + 11,800	+ 34,600	+ 35,100	+ 2,115,300	+ 1,926,600	+ 1,616,600	▲ 0.004	0.16900	0.160	0.455	19,764.72	27.91	119.70	119.96				
14	木	0.068	+ 1,000	△ 38,700	△ 37,700		国債補充供給 + 700 CP等買入 △ 200	+ 500			ETF買入 + 300	+ 300	△ 36,900	+ 2,078,400	+ 1,889,600	+ 1,579,900	▲ 0.002	0.16900	0.160	0.445	19,570.24	25.74	118.89	119.34				
15	金	0.070	+ 700	+ 14,600	+ 15,300		CP等買入 △ 800	△ 800			ETF買入 + 400 国債買入 + 4,900	+ 5,300	+ 19,800	+ 2,098,200	+ 1,908,700	+ 1,591,800	0.000	0.16900	0.150	0.390	19,732.92	25.48	119.16	119.58				
18	月	0.068	+ 1,600	△ 16,400	△ 14,800		CP等買入 △ 300 共通担保(全店) △ 1,800	△ 2,100		共通担保(全店) + 1,300	国債補充供給 △ 200 ETF買入 + 400	+ 1,500	△ 15,400	+ 2,082,800	+ 1,896,200	+ 1,524,200	0.000	0.16900	0.150	0.375	19,890.27	27.64	119.34	119.77				
19	火	0.069	+ 700	+ 4,000	+ 4,700		国債補充供給 + 200 CP等買入 △ 300 共通担保(全店) △ 13,600	△ 13,700		共通担保(全店) + 11,300	ETF買入 + 300 社債等買入 + 1,300 国庫短期証券買入 + 20,000 国債買入 + 11,500	+ 44,400	+ 35,400	+ 2,118,200	+ 1,927,100	+ 1,584,900	0.002	0.16900	0.145	0.380	20,026.38	25.84	119.84	120.06				
20	水	0.069	△ 300	△ 11,800	△ 12,100		CP等買入 △ 400	△ 400			国債買入 + 4,400	+ 4,400	△ 8,100	+ 2,110,100	+ 1,914,100	+ 1,586,600	0.002	0.16900	0.150	0.390	20,196.56	25.70	120.58	121.10				
21	木	0.070	△ 1,300	△ 26,100	△ 27,400		CP等買入 △ 100	△ 100			CP等買入 + 3,500	+ 3,500	△ 24,000	+ 2,086,100	+ 1,890,900	+ 1,567,400	0.002	0.16900	0.150	0.405	20,202.87	25.24	120.95	121.30				
22	金	0.072	△ 1,400	△ 1,400	△ 2,800		CP等買入 △ 200 共通担保(全店) △ 3,600	△ 3,800		共通担保(全店) + 7,300	ETF買入 + 200 国債買入 + 11,900	+ 19,400	+ 12,800	+ 2,098,900	+ 1,903,600	+ 1,584,000	0.002	0.16900	0.150	0.410	20,264.41	20.74	120.64	121.09				
25	月	0.069	+ 0	△ 14,900	△ 14,900		社債等買入 △ 400 CP等買入 △ 500 共通担保(全店) △ 2,500	△ 3,400		共通担保(全店) + 2,800	ETF買入 + 200	+ 3,000	△ 15,300	+ 2,083,600	+ 1,894,700	+ 1,576,400	0.000	0.16900	0.145	0.420	20,413.77	20.52	121.51	121.78				
26	火	0.071	△ 200	+ 16,200	+ 16,000		CP等買入 △ 200 共通担保(全店) △ 3,900	△ 4,100		共通担保(全店) + 7,200	国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 200	+ 7,300	+ 19,200	+ 2,102,800	+ 1,913,100	+ 1,598,100	0.000	0.16900	0.145	0.416	20,437.48	19.13	121.54	122.75				
27	水	0.074	△ 900	+ 0	△ 900		国債補充供給 + 100 社債等買入 △ 300 CP等買入 △ 300	△ 500			ETF買入 + 200 国庫短期証券買入 + 22,500 国債買入 + 11,600	+ 34,300	+ 32,900	+ 2,135,700	+ 1,942,400	+ 1,629,800	0.000	0.16900	0.145	0.385	20,472.58	25.51	122.77	123.31				
28	木	0.071	△ 1,300	△ 14,500	△ 15,800		社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 300	△ 400			ETF買入 + 300	+ 300	△ 15,900	+ 2,119,800	+ 1,927,500	+ 1,615,200	0.000	0.16900	0.145	0.395	20,551.46	31.19	123.50	124.30				
29	金	0.073	△ 700	+ 700	+ 0		CP等買入 △ 2,800 共通担保(全店) △ 4,700	△ 7,500		共通担保(全店) + 7,200	CP等買入 + 2,500 国債買入 + 8,200	+ 17,900	+ 10,400	+ 2,130,200	+ 1,944,600	+ 1,633,400	0.003	0.16900	0.145	0.390	20,563.15	32.91	123.61	124.04				
月 中 平 均	0.0693	—	月中実績 + 12,976	月中実績 △ 161,986	月中実績 △ 149,010	—	国債買入 + 80,468	—	月中実績 + 0	月中実績 + 7,075	—	—	—	前月末比 + 28,055	—	—	▲ 0.003	0.16900	0.150	0.405	19,974.19	25.63	120.79	—				
月 中 *	—	—	月末残高 897,315	—	—	—	国庫短期証券買入 + 85,012	—	月末残高 + 0	月末残高 + 74,717	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
平 均	0.0695	—	—	—	—	—	+ 85,012	—	+ 0	+ 74,717	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—				

*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 フ ラ イ ム

1.475 % (H21.1.13~)
1.05 % (H27.1.9~)
1.15 % (H27.2.10~)

注1) 日本銀行発表

注2) TB529~TB535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) 338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