UEDA YAGI MONTHLY DATA ＜平成 28年（2016年） 1月＞

— 青金需給動向と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 28 年 2 月 1 日

利　率：%

金額単位：億円

＊速報ベース

平成28年1月		無担ＯＮ＊ 加重平均	資金過不足 最低 最高	銀行券	財政等	過不足尻	オペエンド 貸出	ＣＰ・国債 手形・共通担保資金供給オペ	計(△)	オペスタート 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	注2) ＴＢ ３ヶ月	ユーロ円 注3) ３ヶ月	金利先物 ３ヶ月	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
			0.030					CP等買入 △ 300																118.91
4	月	0.070	0.125	＋ 6,200	△ 500	＋ 5,700		共通担保(全店) △ 1,500	△ 1,800		共通担保(全店) ＋ 1,300		＋ 1,300	＋ 5,200	＋ 2,535,400	＋ 2,312,000	＋ 1,865,100	▲ 0.039	0.16900	0.155	0.260	18,450.98	19.86	120.46
			0.060																					119.10
5	火	0.074	0.125	＋ 6,100	△ 3,300	＋ 2,800		CP等買入 △ 300	△ 300			国債買入 ＋ 11,100	＋ 11,100	＋ 13,600	＋ 2,549,000	＋ 2,324,700	＋ 1,879,900	▲ 0.038	0.16900	0.155	0.255	18,374.00	19.23	119.70
			0.060																					118.35
6	水	0.075	0.130	＋ 4,800	△ 20,500	△ 15,700		CP等買入 △ 100	△ 100			国債買入 ＋ 5,600	＋ 5,600	△ 10,200	＋ 2,538,800	＋ 2,316,200	＋ 1,871,400	▲ 0.035	0.16900	0.160	0.249	18,191.32	20.76	119.16
			0.060																					117.66
7	木	0.075	0.125	＋ 3,000	△ 21,400	△ 18,400		CP等買入 △ 300	△ 300					△ 18,700	＋ 2,520,100	＋ 2,313,200	＋ 1,866,100	▲ 0.033	0.16900	0.015	0.240	17,767.34	23.74	118.75
			0.050									ETF買入 ＋ 200												117.41
8	金	0.077	0.125	＋ 2,100	＋ 100	＋ 2,200		CP等買入 △ 500	△ 500			国債買入 ＋ 12,900	＋ 13,100	＋ 14,800	＋ 2,534,900	＋ 2,328,800	＋ 1,886,000	▲ 0.027	0.16900	0.155	0.225	17,697.96	25.91	118.59
			0.060					CP等買入 △ 100																117.23
12	火	0.075	0.125	＋ 3,700	△ 12,800	△ 9,100		共通担保(全店) △ 600	△ 700		共通担保(全店) ＋ 800	ETF買入 ＋ 200	＋ 1,000	△ 8,800	＋ 2,526,100	＋ 2,324,400	＋ 1,880,100	▲ 0.027	0.16900	0.150	0.215	17,218.96	26.35	118.04
			0.060									CP等買入 ＋ 3,000												117.66
13	水	0.075	0.125	＋ 3,400	△ 25,300	△ 21,900		CP等買入 △ 200	△ 200			国債買入 ＋ 9,500	＋ 12,500	△ 9,600	＋ 2,516,500	＋ 2,317,400	＋ 1,874,600	▲ 0.027	0.16900	0.150	0.205	17,715.60	21.39	118.36
			0.060									ETF買入 ＋ 300												117.29
												国庫短期証券買入 ＋ 25,000												
14	木	0.075	0.125	＋ 2,100	△ 12,300	△ 10,200		CP等買入 △ 200	△ 200			国債買入 ＋8,900	＋ 34,200	＋ 23,800	＋ 2,540,300	＋ 2,338,400	＋ 1,895,500	▲ 0.027	0.16900	0.145	0.225	17,240.95	26.00	118.18
			0.060																					117.57
15	金	0.075	0.125	＋ 1,700	△ 11,700	△ 10,000		CP等買入 △ 800	△ 800			ETF買入 ＋ 300	＋ 300	△ 10,500	＋ 2,529,800	＋ 2,323,600	＋ 1,879,900	▲ 0.024	0.16900	0.150	0.215	17,147.11	24.48	118.28
			0.050					CP等買入 △ 400																116.74
18	月	0.074	0.125	＋ 2,100	△ 2,600	△ 500		共通担保(全店) △ 2,000	△ 2,400		共通担保(全店) ＋ 1,300	国債買入 ＋ 12,900	＋ 14,200	＋ 11,300	＋ 2,541,100	＋ 2,330,600	＋ 1,814,700	▲ 0.024	0.16900	0.140	0.200	16,955.57	22.30	117.38
			0.030									国債補完供給 △ 100												117.23
												ETF買入 ＋ 200												
								CP等買入 △ 300				社債等買入 ＋ 1,000												
19	火	0.076	0.125	＋ 2,100	＋ 2,900	＋ 5,000		共通担保(全店) △ 3,400	△ 3,700		共通担保(全店) ＋ 6,200	国庫短期証券買入 ＋ 15,000	＋ 22,300	＋ 23,600	＋ 2,564,700	＋ 2,360,300	＋ 1,878,800	▲ 0.022	0.16900	0.145	0.210	17,048.37	21.73	118.00
			0.030									国債補完供給 △ 200												116.40
								国債補完供給 ＋100				ETF買入 ＋ 200												
20	水	0.074	0.125	＋ 800	△ 12,700	△ 11,900		CP等買入 △ 500	△ 400			国債買入 ＋ 9,400	＋ 9,400	△ 2,900	＋ 2,561,800	＋ 2,345,300	＋ 1,880,900	▲ 0.021	0.16900	0.140	0.210	16,416.19	25.66	117.69
			0.050									国債補完供給 △ 100												116.47
								国債補完供給 ＋ 200				ETF買入 ＋ 200												
21	木	0.075	0.125	△ 200	△ 26,700	△ 26,900		CP等買入 △ 100	＋ 100			CP等買入 ＋ 3,000	＋3,100	△ 23,700	＋ 2,538,100	＋ 2,326,900	＋ 1,865,500	▲ 0.021	0.16900	0.145	0.220	16,017.26	31.85	117.48
			0.060					国債補完供給 ＋ 100																117.55
								CP等買入 △ 300				ETF買入 ＋ 100												
22	金	0.075	0.125	△ 1,000	△ 400	△ 1,400		共通担保(全店) △ 9,100	△ 9,300		共通担保(全店) ＋ 6,100	国債買入 ＋ 12,800	＋19,000	＋ 8,300	＋ 2,546,400	＋ 2,332,700	＋ 1,882,400	▲ 0.034	0.16900	0.140	0.230	16,958.53	26.04	118.18
			0.060					社債等買入 △ 400																118.43
								CP等買入 △ 800																
25	月	0.075	0.125	＋ 500	△ 2,100	△ 1,600		共通担保(全店) △ 3,300	△ 4,500		共通担保(全店) ＋ 3,100	ETF買入 ＋ 100	＋3,200	△ 2,900	＋ 2,543,500	＋ 2,328,500	＋ 1,874,800	▲ 0.035	0.16900	0.135	0.220	17,110.91	22.91	118.85
			0.055									ETF買入 ＋ 300												117.65
												国庫短期証券買入 ＋ 25,000												
26	火	0.079	0.125	＋ 100	＋ 1,300	＋ 1,400		CP等買入 △ 100	△ 100			国債買入 ＋ 13,000	＋ 38,300	＋ 39,600	＋ 2,583,100	＋ 2,364,100	＋ 1,911,800	▲ 0.035	0.16900	0.135	0.215	16,708.90	21.57	118.36
			0.060									国債補完供給 △ 100												118.05
												ETF買入 ＋ 200												
27	水	0.076	0.125	△ 200	△ 600	△ 800		CP等買入 △ 100	△ 100			国債買入 ＋ 5,100	＋ 5,200	＋ 4,300	＋ 2,587,400	＋ 2,377,200	＋ 1,925,100	▲ 0.040	0.16900	0.135	0.210	17,163.92	22.57	118.47
			0.060					国債補完供給 ＋ 100																118.42
								社債等買入 △ 100																
28	木	0.074	0.125	△ 800	△ 3,800	△ 4,600		CP等買入 △ 300	△ 300			ETF買入 ＋ 300	＋ 300	△ 4,600	＋ 2,582,800	＋ 2,369,500	＋ 1,920,800	▲ 0.040	0.16900	0.135	0.220	17,041.45	21.45	118.93
			0.010									ETF買入 ＋ 300												118.38
												CP等買入 ＋ 3,500												
29	金	0.066	0.125	△ 200	△ 3,100	△ 3,300		CP等買入 △ 3,600	△ 3,600			国債買入 ＋ 13,300	＋ 17,100	＋ 10,200	＋ 2,593,000	＋ 2,366,300	＋ 1,919,800	▲ 0.106	0.16900	0.150	0.095	17,518.30	41.25	121.49
月中平均		0.0745	—	月中実績 ＋ 36,396	月中実績 △ 155,611	月中実績 △ 119,215	—	国債買入 ＋ 114,500	—	月中実績 ＋ 0	月中実績 △ 1,001	月中実績 ＋ 3,470	月中実績 ＋ 2,469	—	前月末比 ＋ 62,800	—	—	▲ 0.034	0.16900	0.139	0.217	17,302.30	24.48	118.18
月中＊平均		0.0707	—	月末残高 947,903	—	—	—	国庫短期証券買入 ＋ 65,046	—	月末残高 ＋ 0	月末残高 ＋ 62,714	月末残高 ＋ 472,686	＋ 535,400	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

＊翌日ベース

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～)

長期プライム { 1.15 %(H27.2.10～) / 1.10 %(H27.9.10～) }

注1) 日本銀行発表

注2) TB579～TB585回儲(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　金利機構値　公式終値　日本経済新聞

注5) 341回儲(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