UEDA YAGI MONTHLY DATA ＜平成 28年（2016年） 2月＞

— 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 28 年 3 月 1 日

利 率：%

金額単位：億円

＊速報ベース

平成28年2月		無担ON＊ 加重平均	無担ON＊ 最低/最高	資金過不足 銀行券	資金過不足 財政等	資金過不足 過不足尻	オペエンド 貸出	オペエンド CP・国債 手形・共通担保資金供給オペ	オペエンド 計(△)	オペスタート 貸出	オペスタート 手形・共通担保資金供給オペ	オペスタート CP・国債 国庫短期証券・企業金融支援	オペスタート 計	日銀当預・準備預金（後半所要 66,100） 日銀当預 増減	日銀当預・準備預金（後半所要 66,100） 日銀当預 残高	日銀当預・準備預金（後半所要 66,100） 準備預金 残高	積終了先	注2) TB 3ヵ月	ユーロ円 注3) 3ヵ月	ユーロ円 注4) 金利先物 3ヵ月	新発10年国債 注5)	東証平均株価	東証一部出来高	注6) 為替円相場
			0.040					CP等買入 △ 300																121.11
1	月	0.058	0.075	＋ 1,300	△ 4,500	△ 3,200		共通担保(全店) △ 500	△ 800		共通担保(全店) ＋ 400		＋ 400	△ 3,600	＋ 2,589,400	＋ 2,356,600	＋ 1,910,300	▲ 0.196	0.13900	▲ 0.350	0.060	17865.23	35.02	121.49
			0.010									国債補完供給 △ 200												120.36
2	火	0.061	0.125	＋ 1,200	△ 18,700	△ 17,500		CP等買入 △ 100	△ 100			ETF買入 ＋ 200	＋ 0	△ 17,600	＋ 2,571,800	＋ 2,330,900	＋ 1,886,700	▲ 0.198	0.13400	0.025	0.076	17750.68	27.71	121.03
			0.030					国債補完供給 ＋ 200																119.42
								社債等買入 △ 100				国庫短期証券買入 ＋ 10,000												
3	水	0.064	0.125	＋ 900	△ 53,400	△ 52,500		CP等買入 △ 100	＋ 0			国債買入 ＋ 9,000	＋ 19,000	△ 33,500	＋ 2,538,300	＋ 2,298,000	＋ 1,855,800	▲ 0.198	0.13100	0.020	0.058	17191.25	31.03	120.00
			0.030									ETF買入 ＋ 200												117.65
4	木	0.066	0.075	＋ 600	△ 17,000	△ 16,400		CP等買入 △ 100	△ 100			国債補完供給 △ 200		△ 16,500	＋ 2,521,800	＋ 2,282,900	＋ 1,840,500	▲ 0.198	0.12900	0.000	0.054	17044.99	31.28	118.23
			0.040					国債補完供給 ＋ 200																116.55
								社債等買入 △ 100				ETF買入 ＋ 200												
5	金	0.068	0.125	＋ 100	＋ 2,600	＋ 2,700		CP等買入 △ 700	△ 600			国債買入 ＋ 9,700	＋ 9,900	＋ 12,000	＋ 2,533,800	＋ 2,290,600	＋ 1,849,000	▲ 0.168	0.12600	▲ 0.005	0.025	16819.59	33.89	116.99
			0.025					CP等買入 △ 100																116.89
8	月	0.072	0.125	＋ 1,300	△ 11,000	△ 9,700		共通担保(全店) △ 1,700	△ 1,800					△ 11,500	＋ 2,522,300	＋ 2,271,000	＋ 1,831,300	▲ 0.162	0.12400	0.000	0.035	17004.30	27.38	117.53
			0.040									国庫短期証券買入 ＋ 10,000												114.21
9	火	0.073	0.125	＋ 200	＋ 1,600	＋ 1,800		CP等買入 △ 100	△ 100			国債買入 ＋ 13,000	＋ 23,000	＋ 24,700	＋ 2,547,000	＋ 2,302,100	＋ 1,864,500	▲ 0.162	0.12300	0.005	▲ 0.029	16085.44	31.73	115.84
			0.015																					114.26
10	水	0.072	0.125	△ 400	△ 29,900	△ 30,300		CP等買入 △ 500	△ 500			CP等買入 ＋3,500	＋ 3,500	△ 27,300	＋ 2,519,700	＋ 2,284,300	＋ 1,846,700	▲ 0.160	0.11700	0.035	0.005	15713.39	38.49	115.26
			0.010																					111.60
12	金	0.071	0.125	＋ 0	△ 7,700	△ 7,700		CP等買入 △ 800	△ 800			国債補完供給 △ 200	△ 200	△ 8,700	＋ 2,511,000	＋ 2,273,000	＋ 1,835,300	▲ 0.116	0.11500	0.015	0.075	14952.61	47.04	113.02
			0.010					国債補完供給 ＋ 200																113.28
								CP等買入 △ 600																
15	月	0.074	0.125	＋ 900	＋ 44,500	＋ 45,400		共通担保(全店) △ 1,100	△ 1,500			国債買入 ＋ 9,700	＋ 9,700	＋ 53,600	＋ 2,564,600	＋ 2,332,700	＋ 1,882,100	▲ 0.115	0.11500	0.050	0.085	16022.58	32.80	114.09
			0.000									国債補完供給 △ 300												114.30
												ETF買入 ＋ 400												
16	火	0.001	0.001	＋ 400	＋ 700	＋ 1,100		CP等買入 △ 100	△ 100			国庫短期証券買入 ＋ 17,500	＋ 17,600	＋ 18,600	＋ 2,583,200	＋ 2,353,400	＋ 850,400	▲ 0.118	0.11000	0.020	0.040	16054.43	31.58	114.87
			△ 0.050									国債補完供給 △ 300												113.37
								国債補完供給 ＋300				ETF買入 ＋ 300												
17	水	△ 0.002	0.001	△ 800	△ 1,800	△ 2,600		CP等買入 △ 200	＋ 100			国債買入 ＋ 13,000	＋ 13,000	＋ 10,500	＋ 2,593,700	＋ 2,369,400	＋ 1,782,300	▲ 0.118	0.10400	0.015	0.045	15836.36	28.40	114.40
			△ 0.040					国債補完供給 ＋ 300				国債補完供給 △ 400												113.76
18	木	△ 0.009	0.001	△ 900	△ 10,200	△ 11,100		CP買入 △ 200	＋ 100			ETF買入 ＋ 100	△ 300	△ 11,300	＋ 2,582,400	＋ 2,355,700	＋ 1,850,400	▲ 0.118	0.10300	0.000	0.015	16196.80	26.28	114.33
			△ 0.040									国債補完供給 △ 500												112.72
												ETF買入 ＋ 600												
								国債補完供給 ＋ 400				CP等買入 ＋ 3,500												
19	金	△ 0.008	0.001	△ 1,100	＋ 2,500	＋ 1,400		CP等買入 △ 600	△ 200			国債買入 ＋ 5,700	＋9,300	＋ 10,700	＋ 2,593,100	＋ 2,355,200	＋ 1,897,300	▲ 0.110	0.10100	▲ 0.040	0.005	15967.17	22.91	113.38
			△ 0.010					国債補完供給 ＋ 500																112.43
								CP等買入 △ 300																
22	月	△ 0.001	0.010	△ 100	△ 41,200	△ 41,300		共通担保(全) △ 2,800	△ 2,600		共通担保(全店) ＋ 2,300	国債補完供給 △ 600	＋1,700	△ 42,200	＋ 2,550,900	＋ 2,320,300	＋ 1,867,200	▲ 0.110	0.10000	▲ 0.025	▲ 0.005	16111.05	20.37	113.05
			△ 0.010					国債補完供給 ＋ 600				国債補完供給 △ 800												111.98
												国庫短期証券買入 ＋ 17,600												
23	火	△ 0.001	0.010	△ 1,200	＋ 4,100	＋ 2,900		CP等買入 △ 100	＋ 500			国債買入 ＋ 13,100	＋ 29,900	＋ 33,300	＋ 2,584,200	＋ 2,350,100	＋ 1,898,000	▲ 0.110	0.09900	▲ 0.015	▲ 0.005	16052.05	23.22	113.05
			△ 0.050					国債補完供給 ＋ 800																111.64
24	水	△ 0.003	0.001	△ 1,600	△ 400	△ 2,000		CP等買入 △ 300	＋ 500			国債補完供給 △ 600	△ 600	△ 2,100	＋ 2,582,100	＋ 2,351,700	＋ 1,896,800	▲ 0.123	0.09900	▲ 0.005	▲ 0.055	15915.79	22.05	112.26
			△ 0.040					国債補完供給 ＋ 600																111.90
								社債等買入 △ 600				国債補完供給 △ 100												
25	木	△ 0.003	0.001	△ 2,300	△ 4,000	△ 6,300		CP等買入 △ 900	△ 900			ETF買入 ＋ 300	＋ 200	△ 7,000	＋ 2,575,100	＋ 2,341,200	＋ 1,886,600	▲ 0.123	0.09900	0.005	▲ 0.065	16140.34	23.98	112.63
			△ 0.040					国債補完供給 ＋ 100				ETF買入 ＋ 100												112.56
								社債等買入 △ 200				社債等買入 ＋ 800												
26	金	△ 0.002	0.001	△ 1,900	△ 1,100	△ 3,000		CP等買入 △ 400	△ 500			国債買入 ＋ 13,400	＋ 14,300	＋ 10,800	＋ 2,585,900	＋ 2,334,700	＋ 1,887,600	▲ 0.095	0.09800	0.000	▲ 0.065	16188.41	21.63	113.22
			△ 0.010					CP等買入 △ 3,100				ETF買入 ＋ 300												112.77
29	月	△ 0.001	0.010	△ 200	＋ 3,600	＋ 3,400		共通担保(全店) △ 1,300	△ 4,400		共通担保(全店) ＋ 700	CP等買入 ＋ 4,000	＋ 5,000	＋ 4,000	＋ 2,589,900	＋ 2,346,000	＋ 1,901,500	▲ 0.095	0.09800	▲ 0.015	▲ 0.065	16026.76	24.92	114.00
月中平均		0.0325	—	月中実績 △ 3,567	月中実績 △ 141,363	月中実績 △ 144,930	—	国債買入 ＋ 86,569	—	月中実績 ＋0	月中実績 △ 4,045	月中実績 ＋ 4,267	月中実績 ＋ 222	—	前月末比 △ 3,044	—	—	▲ 0.140	0.113	▲ 0.013	0.014	16346.961	29.086	115.04
月中＊平均		0.0338	—	月末残高 951,471	—	—	—	国庫短期証券買入 ＋ 55,095	—	月末残高 ＋0	月末残高 ＋ 58,669	月末残高 ＋ 478,344	＋ 537,013	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

＊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～)

長期プライム 1.10 %(H27.9.10～) / 1.00 %(H28.2.10～)

注1) 日本銀行発表

注2) TB585～TB591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 余利複算値 公式終値 日本経済新聞

注5) 341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