

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 28年 (2016年) 2月>

平成 28年 3月 1日

資金需給動向とONレートの足どり・主要 種 別 種 類 上田八木証券株式会社

利率: %

| 期日 年月日 | *注1)ベース | | | | | | オヘビエンド | | | | | | オヘビエスター | | | | | | 注1) | | | | 注2) | | | | 注3) | | | | 注4) | | | | 注5) | | | | | |
|-----------|----------|----------|-----------|-----------|----------|-----------------------------|---------------------------|---------|----------------------------------|--------------------------------------|----------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|------------|----------------------|-----------------|----------------|-----------|------------|--------|------------|--|------------|--|------|--|------------|--|-------------|--|-----------------|--|----------------|--|-----------|--|-----------|--|
| | 資金過不足 | | 銀行券 | | 財政等 | | 過不足原 | | 貸出 | | CP・国債 手前・共通担保(全店) | | 計(△) | | 貸出 | | CP・国債 手前・共通担保(全店) | | 計 | | 日銀当預 増減 | | 日銀当預 残高 | | 準備預金 残高 | | 繰上終了 | | T B 3ヶ月 | | ユーロ円 3ヶ月 | | 新発 10年 国債 | | 東証 平均 株価 | | 一部 出来高 | | 為替 円相場 | |
| | 加重 平均 | 最高 最低 | 銀行券 | 財政等 | 過不足原 | 貸出 | CP・国債 手前・共通担保(全店) | 計(△) | 貸出 | CP・国債 手前・共通担保(全店) | 計 | 日銀当預 増減 | 日銀当預 残高 | 準備預金 残高 | 繰上終了 | T B 3ヶ月 | ユーロ円 3ヶ月 | 新発 10年 国債 | 東証 平均 株価 | 一部 出来高 | 為替 円相場 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1月 | 0.058 | 0.040 | + 1,300 | △ 4,500 | △ 3,200 | CP等買入 共通担保(全店) | △ 300 △ 500 | △ 800 | 共通担保(全店) | + 400 | △ 3,600 | + 2,589,400 | + 2,356,600 | + 1,910,300 | ▲ 0.196 | 0.13900 | ▲ 0.350 | 0.060 | 17865.23 | 35.02 | 121.11 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2月 | 0.061 | 0.010 | + 1,200 | △ 18,700 | △ 17,500 | CP等買入 | △ 100 | △ 100 | 国債補充供給 ETF買入 | △ 200 + 200 | △ 17,600 | + 2,571,800 | + 2,330,900 | + 1,886,700 | ▲ 0.198 | 0.13400 | 0.025 | 0.076 | 17750.68 | 27.71 | 120.36 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3月 | 0.064 | 0.030 | + 900 | △ 53,400 | △ 52,500 | 国債補充供給 社債等買入 CP等買入 | + 200 △ 100 △ 100 | + 0 | 国庫短期証券買入 国債買入 | + 10,000 + 9,000 | △ 33,500 | + 2,538,300 | + 2,298,000 | + 1,855,800 | ▲ 0.198 | 0.13100 | 0.020 | 0.058 | 17191.25 | 31.03 | 119.42 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4月 | 0.066 | 0.030 | + 600 | △ 17,000 | △ 16,400 | CP等買入 | △ 100 | △ 100 | ETF買入 国債補充供給 | + 200 △ 200 | △ 16,500 | + 2,521,800 | + 2,282,900 | + 1,840,500 | ▲ 0.198 | 0.12900 | 0.000 | 0.054 | 17044.99 | 31.28 | 117.65 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5月 | 0.068 | 0.040 | + 100 | + 2,600 | + 2,700 | 国債補充供給 社債等買入 CP等買入 | + 200 △ 100 △ 700 | △ 600 | ETF買入 国債買入 | + 200 + 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 | 116.89 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8月 | 0.072 | 0.025 | + 1,300 | △ 11,000 | △ 9,700 | CP等買入 共通担保(全店) | △ 100 △ 1,700 | △ 1,800 | CP等買入 共通担保(全店) | △ 100 △ 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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 9月 | 0.073 | 0.040 | + 200 | + 1,600 | + 1,800 | CP等買入 | △ 100 | △ 100 | 国庫短期証券買入 国債買入 | + 10,000 + 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 | 114.21 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10月 | 0.072 | 0.015 | △ 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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 12月 | 0.071 | 0.010 | + 0 | △ 7,700 | △ 7,700 | CP等買入 | △ 800 | △ 800 | 国債補充供給 | △ 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 | 111.60 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 15月 | 0.074 | 0.010 | + 900 | + 44,500 | + 45,400 | 国債補充供給 CP等買入 共通担保(全店) | + 200 △ 600 △ 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 | 113.28 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 16月 | 0.001 | 0.000 | + 400 | + 700 | + 1,100 | CP等買入 | △ 100 | △ 100 | 国債補充供給 ETF買入 国庫短期証券買入 | △ 300 + 400 + 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 | 114.30 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 17月 | △ 0.002 | △ 0.050 | △ 800 | △ 1,800 | △ 2,600 | 国債補充供給 ETF買入 CP等買入 | + 300 + 300 △ 200 | + 100 | 国債補充供給 ETF買入 国債買入 | △ 300 + 300 + 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 | 113.37 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 18月 | △ 0.009 | △ 0.040 | △ 900 | △ 10,200 | △ 11,100 | 国債補充供給 CP等買入 | + 300 △ 200 | + 100 | 国債補充供給 ETF買入 | △ 400 + 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 | 113.76 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 19月 | △ 0.008 | △ 0.040 | △ 1,100 | + 2,500 | + 1,400 | 国債補充供給 CP等買入 | + 400 △ 600 | △ 200 | 国債補充供給 ETF買入 CP等買入 国債買入 | △ 500 + 600 + 3,500 + 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 | 114.33 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 22月 | △ 0.001 | △ 0.010 | △ 100 | △ 41,200 | △ 41,300 | 国債補充供給 CP等買入 共通担保(全) | + 500 △ 300 △ 2,800 | △ 2,600 | 国債補充供給 ETF買入 国庫短期証券買入 | + 500 + 600 + 17,600 | + 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 | 112.43 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 23月 | △ 0.001 | △ 0.010 | △ 1,200 | + 4,100 | + 2,900 | 国債補充供給 CP等買入 | + 600 △ 300 | + 500 | 国債補充供給 ETF買入 国債買入 | △ 800 + 17,600 + 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 | 111.98 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 24月 | △ 0.003 | △ 0.050 | △ 1,600 | △ 400 | △ 2,000 | 国債補充供給 社債等買入 CP等買入 | + 600 △ 600 △ 300 | + 500 | 国債補充供給 | △ 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 | 113.05 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 25月 | △ 0.003 | △ 0.040 | △ 2,300 | △ 4,000 | △ 6,300 | 国債補充供給 社債等買入 CP等買入 | + 600 △ 600 △ 900 | △ 900 | 国債補充供給 ETF買入 | △ 100 + 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 | 112.56 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 26月 | △ 0.002 | △ 0.040 | △ 1,900 | △ 1,100 | △ 3,000 | 国債補充供給 社債等買入 CP等買入 | + 100 △ 200 △ 400 | △ 500 | ETF買入 社債等買入 国債買入 | + 100 + 800 + 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 | 112.77 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 28月 | △ 0.001 | △ 0.010 | △ 200 | + 3,600 | + 3,400 | CP等買入 共通担保(全店) | △ 3,100 △ 1,300 | △ 4,400 | ETF買入 共通担保(全店) | + 300 + 700 | + 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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 平均 | 0.0338 | 951.471 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 月平均 | 0.0325 | △ 3,567 | △ 141,363 | △ 144,930 | | 国債買入 | + 86,569 | | 月平均 | △ 4,045 | + 0 | △ 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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 月平均 | 0.0338 | △ 3,567 | △ 141,363 | △ 144,930 | | 国債買入 | + 86,569 | | 月平均 | △ 4,045 | + 0 | △ 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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 月平均 | 0.0338 | 951.471 | | | | 国庫短期証券買入 | + 55,095 | | 月平均 | + 55,095 | + 58,669 | + 478,344 | | | | + 507,013 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

*暦日ベース 基準貸付金利 { 0.75 % (H19: 2.21~) , 0.50 % (H20: 19.21~) , 0.30 % (H20: 12.19~) } 短期プライム { 1.475 % (H21: 1.13~) , 1.10 % (H27: 9.10~) } 長期プライム { 1.00 % (H28: 2.10~) } 注1) 日本銀行発表 注2) TB385~TB591国債(日本国元証債) 日本経済新聞 注3) TBOR(東京銀行間取引金利) 日本経済新聞 注4) 中心座月 金利換算値 公式略値 日本経済新聞 注5) 34国債(日本国元証債) 日本経済新聞 注6) 上段は高値、下段は安値 日本経済新聞