

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 28年 (2016年) 3月>

平成 28年 4月 1日

利率: %

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

平成28年3月	*速報ベース			資金過不足			オペレンド		オペスタート		注1)				注2)		注3)		注4)		注5)		注6)
	無担O/N*	加重平均	最低最高	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	CP・国債 手形・共通担保資金供給オペ	計	日銀当預 増減	日銀当預 残高	日銀当預・準備預金(後半所要 66,400) 準備預金 残高	積終了先	T B 3ヵ月	ユーロ円 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	
1 火	△ 0.003	0.001	△ 0.040	△ 100	△ 10,000	△ 10,100		CP等買入 △ 300 社債等買入 △ 100 国債補完供給 + 200	△ 400		国債買入 + 6,000 国債短期証券買入 + 7,500 国債補完供給 △ 200	+ 13,300	+ 2,800	+ 2,592,700	+ 2,336,500	+ 1,896,900	▲ 0.095	0.0980	▲ 0.005	▲ 0.045	16085.51	22.24	113.03
2 水	△ 0.002	0.001	△ 0.040	+ 100	△ 52,300	△ 52,200		CP等買入 △ 400	△ 200		国債買入 + 13,400	+ 13,400	△ 39,000	+ 2,553,700	+ 2,300,300	+ 1,862,100	▲ 0.095	0.0980	0.020	▲ 0.040	16746.55	24.89	113.75
3 木	△ 0.002	0.001	△ 0.040	△ 100	△ 3,800	△ 3,900		CP等買入 △ 100	△ 100		国債補完供給 △ 100	△ 100	△ 4,100	+ 2,549,600	+ 2,305,000	+ 1,867,200	▲ 0.095	0.0980	0.025	▲ 0.020	16960.16	27.44	113.41
4 金	△ 0.001	0.001	△ 0.030	△ 200	+ 3,500	+ 3,300		成長基盤強化 △ 3,400 国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 600	△ 3,900		国債買入 + 5,500 ETF買入 + 100 成長基盤強化 + 7,100	+ 12,700	+ 12,100	+ 2,561,700	+ 2,313,400	+ 1,877,300	▲ 0.099	0.0980	0.030	▲ 0.040	17014.78	26.52	113.20
7 月	△ 0.001	0.001	△ 0.010	+ 1,100	△ 4,100	△ 3,000		成長基盤強化 △ 100 CP等買入 △ 700 共通担保(本店) △ 500	△ 1,300		成長基盤強化 + 100 国債補完供給 △ 200	+ 100	△ 4,200	+ 2,557,500	+ 2,317,300	+ 1,882,300	▲ 0.099	0.0980	0.030	▲ 0.050	16911.32	22.16	113.50
8 火	0.000	0.001	△ 0.010	+ 1,100	+ 1,400	+ 2,500		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 100	+ 100		国債買入 + 13,700	+ 21,200	+ 23,800	+ 2,581,300	+ 2,337,900	+ 1,903,900	▲ 0.099	0.0980	0.025	▲ 0.100	16783.15	25.46	112.75
9 水	△ 0.001	0.001	△ 0.010	+ 400	+ 7,700	+ 8,100		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 300	△ 200				+ 7,900	+ 2,589,200	+ 2,348,500	+ 1,916,400	▲ 0.091	0.0980	0.040	▲ 0.020	16642.20	22.49	112.42
10 木	△ 0.003	0.001	△ 0.040	△ 100	△ 10,900	△ 11,000		社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 600	△ 700		CP等買入 + 5,000 国債補完供給 △ 300	+ 4,700	△ 7,000	+ 2,582,200	+ 2,336,600	+ 1,903,700	▲ 0.091	0.0980	0.050	▲ 0.024	16852.35	19.83	112.75
11 金	△ 0.001	0.001	△ 0.010	△ 400	+ 900	+ 500		国債補完供給 + 300 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 1,000	△ 800		国債買入 + 10,000 国債補完供給 △ 200	+ 9,800	+ 9,500	+ 2,591,700	+ 2,352,600	+ 1,919,900	▲ 0.088	0.0980	0.060	▲ 0.015	16938.87	27.61	113.81
14 月	△ 0.002	0.001	△ 0.040	+ 900	+ 4,700	+ 5,600		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 400	△ 200		国債補完供給 △ 400	△ 400	+ 5,000	+ 2,596,700	+ 2,356,600	+ 1,925,000	▲ 0.090	0.0980	0.065	▲ 0.049	17233.75	20.19	113.64
15 火	△ 0.002	0.010	△ 0.040	+ 400	△ 11,900	△ 11,500		国債補完供給 + 400 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 1,000	△ 700		国債補完供給 △ 1,200 国債短期証券買入 + 12,500 国債買入 + 13,100	+ 24,400	+ 12,200	+ 2,608,900	+ 2,365,400	+ 1,935,200	▲ 0.104	0.0980	0.020	▲ 0.025	17117.07	20.93	113.02
16 水	0.002	0.125	△ 0.040	△ 600	+ 2,000	+ 1,400		国債補完供給 + 1,200 CP等買入 △ 500	+ 700		国債補完供給 △ 2,200	△ 2,200	△ 100	+ 2,608,800	+ 2,364,200	+ 848,900	▲ 0.112	0.0980	0.015	▲ 0.054	16974.45	18.61	114.00
17 木	△ 0.003	0.001	△ 0.040	△ 1,300	+ 2,300	+ 1,000		国債補完供給 + 2,200 CP等買入 △ 100	+ 2,100		国債補完供給 △ 2,200	△ 2,200	+ 900	+ 2,609,700	+ 2,364,800	+ 1,797,500	▲ 0.112	0.0980	0.010	▲ 0.054	16936.38	22.07	113.02
18 金	△ 0.002	0.001	△ 0.010	△ 2,000	+ 7,500	+ 5,500		貸出支援増加支援 △ 24,400 国債補完供給 + 2,200 社債等買入 △ 900 CP等買入 △ 800 共通担保(全店) △ 13,200	△ 37,100		貸出増加支援 + 23,500 国債補完供給 △ 2,300 国債買入 + 13,000	+ 40,800	+ 9,200	+ 2,618,900	+ 2,371,000	+ 1,931,300	▲ 0.110	0.0980	▲ 0.010	▲ 0.100	16724.81	22.95	111.68
22 火	△ 0.003	0.010	△ 0.040	△ 100	+ 39,700	+ 39,600		国債補完供給 + 2,300 社債等買入 △ 300 CP等買入 △ 800 共通担保(全店) △ 11,200	△ 10,000		国債補完供給 △ 1,900 ETF買入 + 200 国債買現 + 3,900	+ 7,000	+ 36,600	+ 2,655,500	+ 2,411,800	+ 1,943,000	▲ 0.111	0.0980	0.005	▲ 0.100	17048.55	20.14	111.68
23 水	△ 0.004	0.005	△ 0.015	△ 200	+ 3,500	+ 3,300		国債補完供給 + 1,900 CP等買入 △ 200 国債買現 △ 3,900	△ 2,200		国債補完供給 △ 2,400 CP等買入 + 5,000 国債短期証券買入 + 17,500	+ 33,900	+ 35,000	+ 2,690,500	+ 2,435,500	+ 1,971,700	▲ 0.113	0.0980	0.010	▲ 0.110	17000.98	16.02	112.14
24 木	△ 0.003	0.005	△ 0.040	△ 1,500	△ 3,000	△ 4,500		国債補完供給 + 2,400 CP等買入 △ 300	+ 2,100		国債買入 + 13,800	+ 33,900	+ 35,000	+ 2,690,500	+ 2,435,500	+ 1,971,700	▲ 0.113	0.0980	0.010	▲ 0.110	17000.98	16.02	112.47
25 金	△ 0.007	0.001	△ 0.040	△ 1,300	+ 18,000	+ 16,700		国債補完供給 + 2,700 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 1,200 共通担保(全店) △ 8,200	△ 6,800		国債補完供給 △ 1,300 ETF買入 + 500	△ 200	+ 9,700	+ 2,700,400	+ 2,435,400	+ 1,974,100	▲ 0.120	0.0980	0.010	▲ 0.100	17002.75	18.12	112.30
26 月	△ 0.007	0.005	△ 0.040	+ 0	+ 7,000	+ 7,000		国債補完供給 + 1,300 CP等買入 △ 500	+ 800		国債補完供給 △ 1,100 社債等買入 + 1,500 国債買入 + 12,800	+ 13,900	+ 21,700	+ 2,722,100	+ 2,460,100	+ 2,004,600	▲ 0.120	0.0980	0.010	▲ 0.095	17134.37	18.45	112.22
29 火	△ 0.006	0.001	△ 0.020	△ 400	△ 3,800	△ 4,200		国債補完供給 + 1,100 CP等買入 △ 800 共通担保(全店) △ 2,400	△ 2,100		国債補完供給 △ 1,000 国債短期証券買入 + 10,000	+ 9,600	+ 3,300	+ 2,725,400	+ 2,465,300	+ 2,015,800	▲ 0.120	0.0980	0.005	▲ 0.090	17103.53	17.50	112.14
30 水	△ 0.007	0.001	△ 0.025	△ 200	+ 18,800	+ 18,600		国債補完供給 + 1,000 CP等買入 △ 600	+ 400		国債買入 + 5,100 国債補完供給 △ 1,200	+ 3,900	+ 22,900	+ 2,748,300	+ 2,485,800	+ 2,037,000	▲ 0.120	0.0980	0.000	▲ 0.095	16878.96	19.11	112.30
31 木	△ 0.002	0.001	△ 0.015	+ 0	+ 9,700	+ 9,700		国債補完供給 + 1,200 CP等買入 △ 8,100	△ 6,900		国債補完供給 △ 1,900 CP等買入 + 5,300	+ 3,400	+ 6,200	+ 2,754,500	+ 2,507,800	+ 2,052,300	▲ 0.120	0.0980	0.000	▲ 0.050	16758.67	22.25	112.15
平均	△ 0.0027	0.001	△ 0.0476	955.947	+ 26.519	+ 22.042		国債買入 + 111.638	+ 0		国債買入 + 504.546	+ 541.285					▲ 0.105	0.098	0.019	▲ 0.062	16897.34	21.59	113.01

\*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 1.00 % (H27.9.10~ )  
0.95 % (H28.3.10~ )

注1) 日本銀行発表  
注2) TB591~TB597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) 342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