

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 28年 (2016年) 4月>

平成 28年 5月 2日

— 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4月	*速報ベース			資金過不足			オペランド			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	過不足尻	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 (後半所要 68,200)	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	為替 円相場	
1 金	△ 0.006	0.001	△ 0.015	△ 600	△ 4,700	△ 5,300		国債補完供給 + 1,900 CP等買入 △ 200 共通担保(全店) △ 1,100	+ 600		国債補完供給 △ 2,100 国債買入 + 13,100	+ 11,000	+ 6,300	+ 2,760,800	+ 2,491,000	+ 2,043,300	▲ 0.119	0.0980	▲ 0.040	▲ 0.066	16164.16	25.79	112.57	112.07	
4 月	△ 0.007	0.001	△ 0.015	+ 1,700	△ 4,000	△ 2,300		国債補完供給 + 2,100 CP等買入 △ 100 共通担保(全店) △ 5,900	△ 3,900	共通担保(全店) + 2,000	国債補完供給 △ 1,400	+ 600	△ 5,600	+ 2,755,200	+ 2,486,900	+ 2,040,000	▲ 0.116	0.0980	▲ 0.050	▲ 0.085	16123.27	20.68	111.80	111.32	
5 火	△ 0.007	0.001	△ 0.020	+ 1,100	△ 200	+ 900		国債補完供給 + 1,400 CP等買入 △ 800	+ 600		国債補完供給 △ 1,000 国債買入 + 5,300	+ 4,300	+ 5,800	+ 2,761,000	+ 2,492,400	+ 2,045,100	▲ 0.113	0.0980	▲ 0.050	▲ 0.070	15732.82	22.33	111.31	110.31	
6 水	△ 0.007	0.001	△ 0.015	+ 1,000	+ 3,600	+ 4,600		国債補完供給 + 1,000 CP等買入 △ 100	+ 900		国債買入 + 13,200 国債補完供給 △ 800	+ 12,400	+ 17,900	+ 2,778,900	+ 2,505,900	+ 2,057,800	▲ 0.095	0.0980	▲ 0.050	▲ 0.065	15715.36	21.47	110.64	110.23	
7 木	△ 0.007	0.001	△ 0.015	+ 300	△ 23,000	△ 22,700		国債補完供給 + 800 CP等買入 △ 300	+ 500		国債補完供給 △ 600	△ 600	△ 22,800	+ 2,756,100	+ 2,487,400	+ 2,039,900	▲ 0.117	0.0960	▲ 0.065	▲ 0.060	15749.84	21.12	109.90	108.52	
8 金	△ 0.012	0.001	△ 0.040	+ 100	+ 6,200	+ 6,300		国債補完供給 + 600 CP等買入 △ 500	+ 100		国債補完供給 △ 1,300 国債買入 + 12,700	+ 11,400	+ 17,800	+ 2,773,900	+ 2,498,900	+ 2,051,800	▲ 0.478	0.0960	▲ 0.075	▲ 0.085	15821.52	25.04	109.10	107.63	
11 月	△ 0.006	0.001	△ 0.015	+ 1,600	△ 31,300	△ 29,700		国債補完供給 + 1,300 CP等買入 △ 400 共通担保(全店) △ 1,500	△ 600	共通担保(全店) + 600	国債補完供給 △ 700 CP等買入 + 2,500	+ 2,400	△ 27,900	+ 2,746,000	+ 2,479,200	+ 2,034,200	▲ 0.477	0.0960	▲ 0.065	▲ 0.090	15751.13	18.26	108.32	107.87	
12 火	△ 0.005	0.001	△ 0.030	+ 800	+ 1,700	+ 2,500		国債補完供給 + 700 CP等買入 △ 300	+ 400		国庫短期証券買入 + 17,500 ETF買入 + 300 国債補完供給 △ 1,000 国債買入 + 5,400	+ 22,200	+ 25,100	+ 2,771,100	+ 2,498,100	+ 2,053,900	▲ 0.474	0.0960	▲ 0.050	▲ 0.099	15928.79	21.38	108.41	108.52	
13 水	△ 0.010	0.001	△ 0.040	+ 400	△ 400	+ 0		国債補完供給 + 1,000 CP等買入 △ 300	+ 700		国債補完供給 △ 1,000	△ 1,000	△ 300	+ 2,770,800	+ 2,496,500	+ 2,053,400	▲ 0.472	0.0960	▲ 0.055	▲ 0.090	16381.22	22.55	109.05	109.19	
14 木	△ 0.005	0.001	△ 0.030	△ 800	△ 400	△ 1,200		国債補完供給 + 1,000 CP等買入 △ 300	+ 700		国債補完供給 △ 600 ETF買入 + 200	△ 400	△ 900	+ 2,769,900	+ 2,495,600	+ 2,049,300	▲ 0.471	0.0960	▲ 0.040	▲ 0.095	16911.05	25.02	109.55	109.22	
15 金	△ 0.010	0.001	△ 0.040	△ 700	+ 70,200	+ 69,500		国債補完供給 + 600 CP等買入 △ 500	+ 100		国債補完供給 △ 600 ETF買入 + 300 国債買入 + 12,700	+ 12,400	+ 82,000	+ 2,851,900	+ 2,571,000	+ 2,110,600	▲ 0.185	0.0960	▲ 0.035	▲ 0.115	16848.03	19.85	109.74	107.83	
18 月	△ 0.074	0.010	△ 0.086	+ 600	△ 9,600	△ 9,000		国債補完供給 + 600 CP等買入 △ 100 共通担保(全店) △ 3,300	△ 2,800	共通担保(全店) + 3,200	ETF買入 + 100	+ 3,300	△ 8,500	+ 2,843,400	+ 2,556,800	+ 2,039,700	▲ 0.187	0.0890	▲ 0.050	▲ 0.120	16275.95	21.82	108.46	108.80	
19 火	△ 0.078	0.010	△ 0.086	△ 1,100	+ 4,400	+ 3,300		社債等買入 △ 200 CP等買入 △ 200	△ 400		ETF買入 + 300 国庫短期証券買入 + 10,000 国債買入 + 12,800	+ 23,100	+ 26,000	+ 2,869,400	+ 2,574,500	+ 2,088,200	▲ 0.187	0.0780	▲ 0.055	▲ 0.130	16874.44	20.97	109.23	108.77	
20 水	△ 0.080	0.000	△ 0.086	△ 1,400	△ 25,800	△ 27,200		CP等買入 △ 500	△ 500		国債補完供給 △ 700 CP等買入 + 3,000 国債買入 + 5,800	+ 8,100	△ 19,600	+ 2,849,800	+ 2,549,500	+ 2,079,300	▲ 0.189	0.0720	▲ 0.055	▲ 0.135	16906.54	20.88	109.30	109.52	
21 木	△ 0.081	0.000	△ 0.086	△ 2,300	△ 25,300	△ 27,600		国債補完供給 + 700 CP等買入 △ 100	+ 600		国債補完供給 △ 100 ETF買入 + 300	+ 200	△ 26,800	+ 2,823,000	+ 2,527,500	+ 2,059,400	▲ 0.228	0.0700	▲ 0.050	▲ 0.125	17363.62	22.83	109.90	109.26	
22 金	△ 0.080	0.001	△ 0.086	△ 2,700	△ 9,600	△ 12,300		国債補完供給 + 100 社債等買入 △ 300 CP等買入 △ 500	△ 700		国債補完供給 △ 400 被災地金融機関支援 + 1,100 国債買入 + 12,600	+ 13,300	+ 300	+ 2,823,300	+ 2,533,900	+ 2,071,200	▲ 0.310	0.0670	▲ 0.070	▲ 0.125	17572.49	30.11	110.75	111.04	
25 月	△ 0.075	0.000	△ 0.086	△ 1,200	△ 100	△ 1,300		国債補完供給 + 400 社債等買入 △ 300 CP等買入 △ 500	△ 4,100	共通担保(全店) + 3,200	国債補完供給 △ 200	+ 3,000	△ 2,400	+ 2,820,900	+ 2,538,900	+ 2,076,900	▲ 0.310	0.0650	▲ 0.055	▲ 0.075	17439.30	23.49	111.78	110.67	
26 火	△ 0.067	0.010	△ 0.086	△ 3,300	+ 6,500	+ 3,200		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 200	+ 0		国債補完供給 △ 100 社債等買入 + 1,000 国庫短期証券買入 + 15,000 国債買入 + 12,900	+ 28,800	+ 32,000	+ 2,852,900	+ 2,561,100	+ 2,100,600	▲ 0.310	0.0600	▲ 0.050	▲ 0.050	17353.28	22.20	111.30	111.03	
27 水	△ 0.058	0.001	△ 0.086	△ 4,200	△ 9,900	△ 14,100		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 200	△ 100		国債補完供給 △ 100 ETF買入 + 600	+ 500	△ 13,700	+ 2,839,200	+ 2,539,800	+ 2,081,400	▲ 0.310	0.0600	▲ 0.040	▲ 0.070	17290.49	20.40	111.33	108.05	
28 木	△ 0.056	0.000	△ 0.078	△ 4,300	+ 4,900	+ 600		国債補完供給 + 100 社債等買入 △ 300 CP等買入 △ 2,400	△ 8,800	共通担保(全店) + 100	国債補完供給 △ 300 CP等買入 + 4,000 国債買入 + 9,300	+ 13,100	+ 4,900	+ 2,844,100	+ 2,454,700	+ 2,091,600	▲ 0.285	0.0600	▲ 0.010	▲ 0.085	16666.05	31.59	111.88		
月 中 平 均	△ 0.0366			月中実績 △ 15,093	月中実績 △ 46,829	月中実績 △ 61,922		国債買入 + 115,771		月中実績 + 0	月中実績 △ 12,624		月中実績 + 5,874		月中実績 △ 6,750		前月末比 + 89,656	▲ 0.272	0.084	▲ 0.051	▲ 0.092	16543.47	22.89	109.81	
月 中 平 均	△ 0.0353			月末残高 971,041				国庫短期証券買入 + 42,557		月末残高 + 0	月末残高 + 24,115		月末残高 + 502,054												

\*速報ベース 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) TB597~TB604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 公式株価 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