

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 28年 (2016年) 5月>

平成 28年 6月 1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5月	*連動ベース			資金過不足			オペエンド			オペスタート			注1)				注2)		注3)		注4)		注5)		注6)	
	加重平均	最低最高	無担ON*	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	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	積戻先	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	金銀単位: 億円		
	△ 0.067	0.000	△ 0.086	△ 100	△ 24,800	△ 24,900		国債補完供給 + 300 CP等買入 △ 500 共通担保(全店) △ 9,700	△ 9,900		共通担保(全店) + 1,800	国債補完供給 △ 100 ETF買入 + 100 国庫短期証券買入 + 20,000 国債買入 + 5,700	+ 1,700	△ 33,100	+ 2,811,000	+ 2,536,800	+ 2,083,600	▲ 0.285	0.0600	0.000	▲ 0.115	16147.38	24.95	106.72		
2月	△ 0.067	0.000	△ 0.086	△ 100	△ 24,800	△ 24,900		国債補完供給 + 300 CP等買入 △ 500 共通担保(全店) △ 9,700	△ 9,900		共通担保(全店) + 1,800	国債補完供給 △ 100 ETF買入 + 100 国庫短期証券買入 + 20,000 国債買入 + 5,700	+ 1,700	△ 33,100	+ 2,811,000	+ 2,536,800	+ 2,083,600	▲ 0.285	0.0600	0.000	▲ 0.115	16147.38	24.95	106.72		
6金	△ 0.066	0.001	△ 0.086	+ 2,900	△ 7,700	△ 4,800		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 800	△ 700			国債補完供給 △ 500 ETF買入 + 100	△ 400	△ 5,900	+ 2,805,100	+ 2,530,000	+ 2,077,400	▲ 0.285	0.0600	▲ 0.010	▲ 0.120	16106.72	21.40	106.89		
9月	△ 0.066	0.000	△ 0.086	+ 3,700	△ 23,500	△ 19,800		国債補完供給 + 500 CP等買入 △ 300 共通担保(全店) △ 3,200	△ 3,000		共通担保(全店) + 2,900	国債補完供給 △ 200 ETF買入 + 200 国庫短期証券買入 + 20,000 国債買入 + 5,700	+ 28,600	+ 5,800	+ 2,810,900	+ 2,533,700	+ 2,083,400	▲ 0.284	0.0600	▲ 0.030	▲ 0.110	16216.03	17.18	107.69		
10火	△ 0.068	0.001	△ 0.086	+ 3,900	+ 1,200	+ 5,100		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 400	△ 200			国債補完供給 △ 1,000	△ 1,000	+ 3,900	+ 2,814,800	+ 2,542,300	+ 2,091,400	▲ 0.275	0.0600	▲ 0.035	▲ 0.100	16565.19	23.72	108.27		
11水	△ 0.065	0.001	△ 0.086	+ 3,200	+ 700	+ 3,900		国債補完供給 + 1,000 CP等買入 △ 200	+ 800			国債補完供給 △ 100 国債買入 + 13,100	+ 13,000	+ 17,700	+ 2,832,500	+ 2,550,400	+ 2,101,000	▲ 0.238	0.0600	▲ 0.035	▲ 0.105	16579.01	21.28	108.54		
12木	△ 0.063	0.001	△ 0.086	+ 1,600	△ 38,300	△ 36,700		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 200	△ 100					△ 36,800	+ 2,795,700	+ 2,516,900	+ 2,080,300	▲ 0.238	0.0600	▲ 0.045	▲ 0.115	16646.34	20.67	108.23		
13金	△ 0.055	0.001	△ 0.086	+ 1,000	△ 24,300	△ 23,300		CP等買入 △ 400	△ 400			ETF買入 + 1,000 CP等買入 + 3,000 国債買入 + 12,600	+ 16,600	△ 7,100	+ 2,788,600	+ 2,524,300	+ 2,069,000	▲ 0.260	0.0600	▲ 0.050	▲ 0.115	16412.21	25.01	108.53		
16月	△ 0.063	0.001	△ 0.086	+ 2,000	△ 18,100	△ 16,100		共通担保(全店) △ 1,800 CP等買入 △ 1,200	△ 3,000		共通担保(全店) + 2,800	国債補完供給 △ 100 ETF買入 + 300	+ 3,000	△ 16,100	+ 2,772,500	+ 2,505,900	+ 794,500	▲ 0.266	0.0600	▲ 0.055	▲ 0.115	16466.40	19.52	109.13		
17火	△ 0.058	△ 0.010	△ 0.086	+ 1,300	+ 5,800	+ 7,100		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 100	+ 0			国債補完供給 △ 200 ETF買入 + 100 国庫短期証券買入 + 30,000 国債買入 + 9,200	+ 39,100	+ 46,200	+ 2,818,700	+ 2,555,600	+ 1,954,600	▲ 0.266	0.0600	▲ 0.050	▲ 0.115	16652.80	17.84	108.46		
18水	△ 0.059	△ 0.010	△ 0.086	+ 700	+ 2,900	+ 3,600		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 200	+ 0			国債補完供給 △ 200	△ 200	+ 3,400	+ 2,822,100	+ 2,552,300	+ 2,025,400	▲ 0.265	0.0600	▲ 0.050	▲ 0.105	16644.69	23.41	108.73		
19木	△ 0.058	△ 0.010	△ 0.086	△ 200	△ 28,700	△ 28,900		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 200	+ 0			国債補完供給 △ 200	△ 200	△ 29,100	+ 2,793,000	+ 2,521,400	+ 2,030,700	▲ 0.026	0.0600	▲ 0.035	▲ 0.080	16646.66	20.18	109.50		
20金	△ 0.053	0.000	△ 0.086	△ 300	△ 19,500	△ 19,800		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 700	△ 500			ETF買入 + 100 国債買入 + 12,600	+ 12,700	△ 7,600	+ 2,785,400	+ 2,514,100	+ 2,051,900	▲ 0.263	0.0600	▲ 0.050	▲ 0.110	16736.35	18.87	109.94		
23月	△ 0.057	△ 0.010	△ 0.086	+ 400	△ 6,300	△ 5,900		CP等買入 △ 100 共通担保(全店) △ 5,200	△ 5,300		共通担保(全店) + 5,600	国債補完供給 △ 200 CP等買入 + 4,000	+ 9,400	△ 1,800	+ 2,783,600	+ 2,514,500	+ 2,054,200	▲ 0.263	0.0600	▲ 0.045	▲ 0.105	16654.60	17.30	110.07		
24火	△ 0.055	△ 0.010	△ 0.086	△ 600	+ 0	△ 600		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 200	+ 0			国債補完供給 △ 100 ETF買入 + 400 国庫短期証券買入 + 30,000 国債買入 + 12,500	+ 42,800	+ 42,200	+ 2,825,800	+ 2,550,600	+ 2,091,300	▲ 0.268	0.0600	▲ 0.045	▲ 0.110	16498.76	16.27	109.87		
25水	△ 0.055	△ 0.010	△ 0.086	△ 700	+ 500	△ 200		国債補完供給 + 100 社債等買入 △ 200 CP等買入 △ 400	△ 500			国債補完供給 △ 100 ETF買入 + 300 国債買入 + 5,300	+ 5,500	+ 4,800	+ 2,830,600	+ 2,554,500	+ 2,096,900	▲ 0.271	0.0600	▲ 0.040	▲ 0.101	16757.35	16.18	109.87		
26木	△ 0.054	0.000	△ 0.085	△ 1,000	+ 7,400	+ 6,400		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 100	+ 0					+ 6,400	+ 2,837,000	+ 2,555,800	+ 2,098,200	▲ 0.276	0.0600	▲ 0.050	▲ 0.115	16772.46	17.69	110.19		
27金	△ 0.049	0.001	△ 0.085	△ 1,100	+ 100	△ 1,000		CP等買入 △ 400	△ 400			国債補完供給 △ 200 CP等買入 + 1,000 国債買入 + 12,700	+ 13,500	+ 12,100	+ 2,849,100	+ 2,563,800	+ 2,108,800	▲ 0.283	0.0600	▲ 0.055	▲ 0.120	16834.84	18.05	109.42		
30月	△ 0.054	0.001	△ 0.080	+ 600	△ 1,000	△ 400		国債補完供給 + 200 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 400 共通担保(全店) △ 3,600	△ 3,900		共通担保(全店) + 2,500	国債補完供給 △ 500	+ 2,000	△ 2,300	+ 2,846,800	+ 2,579,000	+ 2,126,800	▲ 0.284	0.0600	▲ 0.045	▲ 0.120	17068.02	15.97	110.23		
31火	△ 0.054	0.001	△ 0.080	+ 900	△ 7,500	△ 6,600		国債補完供給 + 500 CP等買入 △ 2,300	△ 1,800			国債補完供給 △ 400 CP等買入 + 4,500 国庫短期証券買入 + 20,000 国債買入 + 5,400	+ 29,500	+ 21,100	+ 2,867,900	+ 2,577,300	+ 2,128,800	▲ 0.284	0.0600	▲ 0.040	▲ 0.120	17234.98	25.28	110.79		
平均	△ 0.0589	0.001	△ 0.080	+ 18,372	△ 181,719	△ 163,346		国債買入 + 89,165	△ 7,824		月中実績 + 0	月中実績 △ 7,824	+ 5,660	△ 2,164	+ 23,787				▲ 0.257	0.0600	▲ 0.040	▲ 0.110	16612.67	20.04	109.16	
平均*	△ 0.0588	0.001	△ 0.085	952,669				国庫短期証券買入 + 100,132	△ 100,132		月末残高 + 0	月末残高 + 16,291	+ 547,353	+ 563,644												

*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~) , 1.00 % (H27.9.10~) }
 長期プライム { 0.95 % (H28.3.10~) }
 注1) 日本銀行発表
 注2) TB004~TB010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