

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 28年 (2016年) 7月>

平成 28年 8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 年月	*速報ベース		資金過不足			オペエピソード		オペスタート				注1)				注2)			注3)			注4)		注5)		注6) 為替 円相場
	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	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	繰終了先	T B 3ヵ月	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	金額単位:億円			
1 金	△ 0.058	△ 0.075 0.050	△ 900	△ 1,800	△ 2,700		国債補充供給 共通担保(全店) △ 200	△ 100	共通担保(全店) + 100	国債買入 + 12,700	+ 12,800	+ 10,000	+ 3,042,800	+ 2,725,600	+ 2,249,600	▲ 0.328	0.0580	▲ 0.035	▲ 0.259	15682.48	17.35		102.44			
4 月	△ 0.057	△ 0.075 0.000	+ 800	△ 34,300	△ 33,500		CP等買入 △ 100 共通担保(全店) △ 4,200	△ 4,300	共通担保(全店) + 2,800	国債補充供給 △ 100	△ 100	△ 35,100	+ 3,007,700	+ 2,714,100	+ 2,238,200	▲ 0.327	0.0580	▲ 0.025	▲ 0.255	15775.80	15.79		102.81			
5 火	△ 0.054	△ 0.078 △ 0.005	+ 1,000	+ 9,400	+ 10,400		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 200 共通担保(全店) △ 600	△ 700	共通担保(全店) + 100	国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 100 国庫短期証券買入 + 20,000	+ 32,800	+ 42,500	+ 3,050,200	+ 2,746,100	+ 2,270,800	▲ 0.327	0.0580	▲ 0.035	▲ 0.205	15669.33	15.78		102.58			
6 水	△ 0.056	△ 0.100 △ 0.020	+ 400	△ 1,100	△ 700		国債補充供給 +100 CP等買入 △ 400	△ 300		国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 300	+ 4,600	+ 3,600	+ 3,053,800	+ 2,754,300	+ 2,278,000	▲ 0.327	0.0580	▲ 0.040	▲ 0.275	15378.99	22.16		101.72			
7 木	△ 0.055	△ 0.100 △ 0.020	△ 100	△ 20,500	△ 20,600		国債補充供給 +100 CP等買入 △ 100	△ 100		国債補充供給 △ 100	△ 100	△ 20,800	+ 3,033,000	+ 2,740,100	+ 2,265,500	▲ 0.327	0.0580	▲ 0.045	▲ 0.280	15276.24	18.32		101.41			
8 金	△ 0.053	△ 0.075 0.000	△ 500	+ 3,700	+ 3,200		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 400 共通担保(全店) △ 600	△ 900	共通担保(全店) + 100	国債補充完きょうきゅう △ 200 ETF買入 + 800	+ 13,800	+ 16,100	+ 3,049,100	+ 2,758,700	+ 2,283,000	▲ 0.313	0.0580	▲ 0.050	▲ 0.290	15106.98	18.45		100.96			
11 月	△ 0.053	△ 0.075 0.000	+ 1,100	△ 59,600	△ 58,500		国債補充供給 + 200 CP等買入 △ 600 共通担保(全店) △ 4,100	△ 4,500	共通担保(全店) + 2,700	国債補充供給 △ 200 ETF買入 + 100	+ 2,600	△ 60,400	+ 2,988,700	+ 2,709,900	+ 2,333,500	▲ 0.314	0.0580	▲ 0.060	▲ 0.280	15708.82	19.96		102.13			
12 火	△ 0.050	△ 0.078 0.000	+ 500	△ 6,000	△ 5,500		国債補充供給 + 200 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 600	△ 500		国債補充供給 △ 3,000 CP等買入 + 3,500 国庫短期証券買入 + 30,000	+ 42,400	+ 36,400	+ 3,025,100	+ 2,735,600	+ 2,261,900	▲ 0.313	0.0580	▲ 0.040	▲ 0.285	16095.65	26.05		103.63			
13 水	△ 0.044	△ 0.070 0.001	+ 600	△ 14,100	△ 13,500		国債補充供給 + 3,000 CP等買入 △ 100	+ 2,900		国債補充供給 △ 3,600	△ 3,600	△ 14,200	+ 3,010,900	+ 2,731,800	+ 2,260,600	▲ 0.311	0.0580	▲ 0.050	▲ 0.285	16231.43	27.39		104.88			
14 木	△ 0.038	△ 0.060 0.001	△ 800	△ 5,700	△ 6,500		国債補充供給 + 3,600 CP等買入 △ 400	+ 3,200		国債補充供給 △ 3,400	△ 3,400	△ 6,700	+ 3,004,200	+ 2,727,100	+ 2,256,700	▲ 0.299	0.0580	▲ 0.045	▲ 0.265	16385.89	20.53		105.75			
15 金	△ 0.034	△ 0.075 0.001	△ 800	△ 7,400	△ 8,200		国債補充供給 + 3,400 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 300	+ 3,000		国債補充供給 △ 3,400 ETF買入 + 200	+ 4,900	△ 300	+ 3,003,900	+ 2,722,500	+ 2,251,300	▲ 0.286	0.0580	▲ 0.035	▲ 0.235	16497.85	25.10		106.32			
19 火	△ 0.040	△ 0.150 0.001	+ 700	△ 30,500	△ 29,800		国債補充供給 +3,400 CP等買入 △ 300 共通担保(全店) △ 2,800	+ 300	共通担保(全店) + 4,000	国債補充供給 △ 500 ETF買入 + 600	+ 4,100	△ 25,400	+ 2,978,500	+ 2,696,500	+ 2,198,000	▲ 0.275	0.0580	▲ 0.035	▲ 0.234	16723.31	20.10		106.33			
20 水	△ 0.037	△ 0.070 0.001	+ 200	△ 19,700	△ 19,500		国債補充供給 + 500 CP等買入 △ 500	+ 0		国債補充供給 △ 900 ETF買入 + 300	+ 8,400	△ 11,100	+ 2,967,400	+ 2,669,600	+ 2,187,200	▲ 0.269	0.0580	▲ 0.035	▲ 0.243	16681.89	18.64		106.39			
21 木	△ 0.035	△ 0.080 0.001	△ 1,000	+ 500	△ 500		国債補充供給 + 900 CP等買入 △ 200	+ 700		国債補充供給 △ 500 CP等買入 + 3,500 国庫短期証券買入 + 35,100	+ 42,800	+ 43,000	+ 3,010,400	+ 2,708,700	+ 2,233,000	▲ 0.268	0.0580	▲ 0.045	▲ 0.235	16810.22	20.06		107.49			
22 金	△ 0.030	△ 0.080 0.001	△ 1,800	△ 11,000	△ 12,800		国債補充供給 + 500 被災地金融機関支援 △ 1,100 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 200	△ 900		国債補充供給 △ 100 被災地金融機関支援 + 1,100	+ 1,000	△ 12,700	+ 2,997,700	+ 2,700,600	+ 2,231,600	▲ 0.276	0.0580	▲ 0.040	▲ 0.230	16627.25	15.91		106.19			
25 月	△ 0.033	△ 0.100 0.001	△ 700	△ 10,100	△ 10,800		国債補充供給 + 100 社債等買入 △ 200 CP買入 △ 300 共通担保(全店) △ 2,700	△ 3,100	共通担保(全店) + 4,800	国債補充供給 △ 300	+ 16,100	+ 2,200	+ 2,999,900	+ 2,710,200	+ 2,242,600	▲ 0.274	0.0580	▲ 0.045	▲ 0.244	16620.29	16.85		106.74			
26 火	△ 0.029	△ 0.070 0.010	△ 1,000	△ 2,300	△ 3,300		国債補充供給 + 300 CP買入 △ 300	+ 0		国債補充供給 △ 300 社債等買入 + 1,000	+ 15,700	+ 12,400	+ 3,012,300	+ 2,707,300	+ 2,241,400	▲ 0.274	0.0580	▲ 0.050	▲ 0.259	16383.04	19.10		105.89			
27 水	△ 0.028	△ 0.050 0.001	△ 600	△ 600	△ 1,200		国債補充供給 + 300 CP買入 △ 400	△ 100		国債補充供給 △ 200	+ 12,500	+ 11,200	+ 3,023,500	+ 2,720,800	+ 2,257,500	▲ 0.277	0.0580	▲ 0.055	▲ 0.298	16664.82	22.39		106.52			
28 木	△ 0.031	△ 0.070 0.001	△ 1,300	△ 3,700	△ 5,000		国債補充供給 + 200 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 100	+ 0		国債補充供給 △ 200	△ 200	△ 5,200	+ 3,018,300	+ 2,704,700	+ 2,245,700	▲ 0.277	0.0580	▲ 0.050	▲ 0.280	16476.84	18.97		105.30			
29 金	△ 0.046	△ 0.075 0.001	△ 800	+ 1,300	+ 500		国債補充供給 + 200 社債等買入 △ 200 CP等買入 △ 2,300	△ 2,300		国債補充供給 △ 500 CP等買入 + 3,500	+ 11,400	+ 9,600	+ 3,027,900	+ 2,713,700	+ 2,255,300	▲ 0.271	0.0580	0.005	▲ 0.180	16569.27	31.88		105.75			
月 中 平 均	△ 0.0431	—	△ 4,961	△ 214,045	△ 219,006		国債買入 + 109,380	—	月中実績 + 0	月中実績 + 5,220	+ 4,539	—	—	—	—	▲ 0.293	0.058	▲ 0.042	▲ 0.256	16217.12	20.98		104.26			
月 中 平 均	△ 0.0431	—	月末残高 964,837	—	—		国庫短期証券買入 + 100,178	—	月末残高 + 0	月末残高 + 583,769	+ 592,939	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—		

*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~)) 短期フライム (1.475 % (H21.1.13~) 0.95 % (H28.3.10~) 0.90 % (H28.7.8~)) 注1) 日本銀行発表 注2) TB616~TB623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 公式計算 日本経済新聞 注5) 343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