

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 28年 (2016年) 8月>

平成 28年 9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 上田八木短資株式会社 —

平成28年8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	過不足残	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	終了先	T B 3ヵ月	注3) 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月	△ 0.040	0.001	△ 0.080	+ 1,000	△ 21,500	△ 20,500		国債補充供給 CP等買入 共通担保(全店)	+ 500 △ 100 △ 4,000	△ 3,600		共通担保(全店)	+ 5,100	国債補充供給	△ 200	+ 4,900	△ 19,200	+ 3,008,700	+ 2,702,300	+ 2,242,600	▲ 0.275	0.0580	0.015	▲ 0.140	16635.77	24.04	102.68					
2火	△ 0.039	0.010	△ 0.080	+ 700	△ 13,200	△ 12,500		国債補充供給 社債等買入 CP等買入	+ 200 △ 100 △ 100	+ 0			国債補充供給 ETF買入	△ 300 + 300	+ 0	△ 12,500	+ 2,996,200	+ 2,700,000	+ 2,241,600	▲ 0.275	0.0580	0.015	▲ 0.065	16391.45	19.74	102.83						
3水	△ 0.041	0.001	△ 0.070	+ 600	△ 46,700	△ 46,100		国債補充供給 社債等買入 CP等買入	+ 300 △ 100 △ 100	+ 100			国債補充供給 国庫短期証券買入	△ 500 + 12,500	+ 21,000	△ 25,000	+ 2,971,200	+ 2,671,900	+ 2,214,500	▲ 0.272	0.0580	0.010	▲ 0.090	16083.11	22.40	101.34						
4木	△ 0.038	0.001	△ 0.075	+ 100	△ 20,300	△ 20,200		国債補充供給 CP等買入	+ 500 △ 100	+ 400			国債補充供給 ETF買入	△ 1,200 + 100	△ 1,100	△ 20,900	+ 2,950,300	+ 2,654,000	+ 2,198,400	▲ 0.268	0.0580	0.010	▲ 0.080	16254.89	22.75	101.68						
5金	△ 0.037	0.010	△ 0.070	+ 100	+ 3,000	+ 3,100		国債補充供給 社債等買入 CP等買入	+ 1,200 △ 100 △ 600	+ 500			国債補充供給 国債買入	△ 500 + 8,000	+ 7,500	+ 11,100	+ 2,961,400	+ 2,674,900	+ 2,220,400	▲ 0.229	0.0580	▲ 0.005	▲ 0.100	16254.45	18.89	101.36						
8月	△ 0.045	0.001	△ 0.070	+ 800	△ 7,000	△ 6,200		国債補充供給 CP等買入 共通担保(全店)	+ 500 △ 200 △ 4,800	△ 4,500		共通担保(全店)	+ 2,000	国債補充供給	△ 300	+ 1,700	△ 9,000	+ 2,952,400	+ 2,665,500	+ 2,211,700	▲ 0.228	0.0580	0.005	▲ 0.055	16650.57	21.17	102.31					
9火	△ 0.048	0.001	△ 0.070	△ 300	+ 600	+ 300		国債補充供給 CP等買入 共通担保(全店)	+ 300 △ 300 △ 100	△ 100		共通担保(全店)	+ 200	国債補充供給 ETF買入 CP等買入 国庫短期証券買入	△ 400 + 100 + 3,500 + 15,000	+ 31,100	+ 31,300	+ 2,983,700	+ 2,683,800	+ 2,231,100	▲ 0.228	0.0580	0.015	▲ 0.085	16764.97	18.92	102.53					
10水	△ 0.047	0.001	△ 0.070	△ 800	△ 16,000	△ 16,800		国債補充供給 CP等買入	+ 400 △ 400	+ 0			国債補充供給	△ 200	△ 200	△ 17,000	+ 2,966,700	+ 2,675,300	+ 2,221,400	▲ 0.227	0.0580	0.015	▲ 0.110	16735.12	17.00	101.96						
12金	△ 0.041	0.001	△ 0.060	△ 600	△ 7,400	△ 8,000		国債補充供給 CP等買入 共通担保(全店)	+ 200 △ 1,200 △ 100	△ 1,100			国債補充供給 ETF買入	△ 200 + 1,100	+ 900	△ 8,200	+ 2,958,500	+ 2,667,100	+ 2,212,100	▲ 0.228	0.0580	0.020	▲ 0.110	16919.92	17.72	102.21						
15月	△ 0.029	0.001	△ 0.050	+ 1,000	+ 31,100	+ 32,100		国債補充供給 社債等買入 CP等買入 共通担保(本店)	+ 200 △ 100 △ 800 △ 5,100	△ 5,800		共通担保(全店)	+ 1,900	国債補充供給 ETF買入 国債買入	△ 1,000 + 200 + 11,800	+ 12,900	+ 39,200	+ 2,997,700	+ 2,713,600	+ 2,245,800	▲ 0.230	0.0580	0.045	▲ 0.089	16869.56	12.43	101.46					
16火	△ 0.044	0.001	△ 0.080	+ 500	+ 3,000	+ 3,500		国債補充供給 CP等買入	+ 1,000 △ 300	+ 700			国債補充供給 国庫短期証券買入 国債買入	△ 300 + 30,000 + 5,400	+ 35,100	+ 39,300	+ 3,037,000	+ 2,732,400	+ 1,187,000	▲ 0.230	0.0580	0.035	▲ 0.099	16596.51	19.78	101.29						
17水	△ 0.044	0.001	△ 0.080	+ 200	+ 1,300	+ 1,500		国債補充供給 CP等買入	+ 300 △ 200	+ 100			国債補充供給	△ 200	△ 200	+ 1,400	+ 3,038,400	+ 2,739,900	+ 2,155,000	▲ 0.230	0.0580	0.035	▲ 0.085	16745.64	17.51	101.16						
18木	△ 0.045	0.050	△ 0.060	△ 400	△ 3,600	△ 4,000		国債補充供給 CP等買入	+ 200 △ 200	+ 0			国債補充供給	△ 200	△ 200	△ 4,200	+ 3,034,200	+ 2,740,400	+ 2,208,200	▲ 0.230	0.0580	0.025	▲ 0.085	16486.01	18.76	100.35						
19金	△ 0.047	0.001	△ 0.080	△ 200	+ 900	+ 700		国債補充供給 CP買入	+ 200 △ 500	△ 300			国債補充供給 CP等買入 国債買入	△ 200 + 3,500 + 8,000	+ 11,300	+ 11,700	+ 3,045,900	+ 2,737,200	+ 2,264,300	▲ 0.239	0.0580	0.025	▲ 0.090	16545.82	17.52	100.47						
22月	△ 0.045	0.001	△ 0.060	+ 400	△ 52,700	△ 52,300		国債補充供給 CP等買入 共通担保(本店)	+ 200 △ 600 △ 2,000	△ 2,400		共通担保(本店)	+ 1,900	国債補充供給 ETF買入	△ 900 + 200	+ 1,200	△ 53,500	+ 2,992,400	+ 2,703,900	+ 2,235,500	▲ 0.239	0.0580	0.015	▲ 0.075	16598.19	14.08	100.94					
23火	△ 0.046	0.001	△ 0.065	△ 200	+ 0	△ 200		国債補充供給 CP等買入	+ 900 △ 200	+ 700			国債補充供給 ETF買入 国庫短期証券買入 国債買入	△ 200 + 1,400 + 25,100 + 12,700	+ 39,000	+ 39,500	+ 3,031,900	+ 2,728,800	+ 2,263,000	▲ 0.236	0.0580	0.020	▲ 0.095	16497.36	15.82	100.39						
24水	△ 0.047	0.001	△ 0.065	△ 100	△ 2,300	△ 2,400		国債補充供給 CP等買入	+ 200 △ 500	△ 300			国債補充供給	△ 300	△ 300	△ 3,000	+ 3,028,900	+ 2,778,300	+ 2,260,900	▲ 0.237	0.0580	0.020	▲ 0.085	16597.30	13.28	100.52						
25木	△ 0.047	0.001	△ 0.065	△ 900	△ 12,200	△ 13,100		国債補充供給 社債等買入 CP等買入	+ 300 △ 100 △ 300	△ 100			国債補充供給 社債等買入	△ 300 + 1,000	+ 700	△ 12,500	+ 3,016,400	+ 2,725,700	+ 2,256,600	▲ 0.237	0.0580	0.010	▲ 0.090	16555.95	13.49	100.62						
26金	△ 0.044	0.010	△ 0.065	△ 1,100	+ 200	△ 900		国債補充供給 被災地金融機関支援 CP等買入	+ 300 △ 400 △ 300	△ 400			国債補充供給 被災地金融機関支援 ETF買入 国債買入	△ 500 + 900 + 200 + 12,100	+ 12,700	+ 11,400	+ 3,027,800	+ 2,734,400	+ 2,265,700	▲ 0.245	0.0580	0.015	▲ 0.075	16360.71	15.46	100.59						
29月	△ 0.046	0.001	△ 0.070	△ 100	△ 20,200	△ 20,300		国債補充供給 CP等買入 共通担保(全店)	+ 500 △ 500 △ 1,900	△ 1,900		共通担保(本店)	+ 1,900	国債補充供給	△ 400	+ 1,500	△ 20,700	+ 3,007,100	+ 2,727,000	+ 2,259,400	▲ 0.247	0.0580	0.020	▲ 0.070	16737.49	16.16	102.39					
30火	△ 0.046	0.001	△ 0.070	+ 300	+ 1,400	+ 1,700		国債補充供給 社債等買入 CP等買入	+ 400 △ 200 △ 600	△ 400			国債補充供給 国庫短期証券買入	△ 400 + 10,000	+ 14,900	+ 16,200	+ 3,023,300	+ 2,736,000	+ 2,272,900	▲ 0.249	0.0580	0.010	▲ 0.078	16725.36	15.49	102.45						
31水	△ 0.048	0.001	△ 0.080	+ 200	+ 900	+ 1,100		国債補充供給 社債等買入 CP等買入	+ 400 △ 100 △ 2,900	△ 2,600			国債補充供給 CP等買入 国債買入	△ 2,000 + 3,500 + 11,700	+ 13,200	+ 11,700	+ 3,035,000	+ 2,731,100	+ 2,268,200	▲ 0.250	0.0580	0.010	▲ 0.069	16887.40	20.89	103.33						
月 中	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
平均	△ 0.0434	—	—	+ 1,328	△ 181,194	△ 179,866	—	国債買入	+ 96,821	—	月中実績 + 0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
月 中*	—	—	—	—	—	—	—	国庫短期証券買入	+ 92,633	—	月末残高 + 0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
平均	△ 0.0432	—	—	963,509	—	—	—	—	—	—	月末残高 + 0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

*暦日ベース 基準貸付金利 0.75 % (H19.2.21~) 短期 フ ラ イ ム 1.475 % (H12.1.13~) 注1) 日本銀行発表 注2) TB623~TB629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) 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