

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 28年 (2016年) 11月>

平成 28年 12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 —

利率: %

金額単位: 億円

平成28年11月	*速報ベース			資金過不足			オベエンド			オベスター			注1)				注2)			注4)			注5)			注6)
	加重平均	最低	最高	銀行券	財政等	過不足残	貸出	CP・国債	計(Δ)	貸出	CP・国債	計	日銀当預増減	日銀当預残高	準備預金残高	積終了先	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	為替 円相場			
	無担ON*	最低	最高					CP・国債			CP・国債															
1 火	△ 0.045	0.001	△ 0.070	△ 100	△ 1,800	△ 1,900		国債補完供給 + 400	+ 400			国債補完供給 △ 500 国庫短期証券買入 + 10,000 国債買入 + 5,300	+ 14,800	+ 13,300	+ 3,172,900	+ 2,861,300	+ 2,392,900	▲ 0.274	0.0560	0.035	▲ 0.054	17442.40	19.06	104.97		
2 水	△ 0.045	0.001	△ 0.070	△ 500	△ 1,400	△ 1,900		国債補完供給 + 500 CP等買入 △ 100	+ 400			国債補完供給 △ 100 ETF買入 + 300 国債買入 + 11,800	+ 12,000	+ 10,500	+ 3,183,400	+ 2,863,800	+ 2,398,000	▲ 0.276	0.0560	0.030	▲ 0.064	17134.68	20.56	104.16		
4 金	△ 0.044	0.010	△ 0.070	+ 200	+ 2,700	+ 2,900		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 100	+ 0			国債補完供給 △ 100	△ 100	+ 2,800	+ 3,186,200	+ 2,866,100	+ 2,400,300	▲ 0.285	0.0560	0.025	▲ 0.065	16905.36	20.56	103.35		
7 月	△ 0.044	0.001	△ 0.070	+ 1,500	△ 19,700	△ 18,200		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 400 共通担保(全店) △ 1,800	△ 2,100		共通担保(全店) + 1,400	国債補完供給 △ 400 ETF買入 + 200	+ 1,200	△ 19,100	+ 3,167,100	+ 2,848,600	+ 2,384,500	▲ 0.286	0.0560	0.035	▲ 0.055	17177.21	17.61	104.58		
8 火	△ 0.044	0.001	△ 0.075	+ 1,400	+ 4,400	+ 5,800		国債補完供給 + 400 CP等買入 △ 200	+ 200			国債補完供給 △ 400 ETF買入 + 400 国庫短期証券買入 + 10,000 国債買入 + 7,800	+ 17,800	+ 23,800	+ 3,190,900	+ 2,863,200	+ 2,401,100	▲ 0.287	0.0560	0.035	▲ 0.070	17171.38	16.59	104.59		
9 水	△ 0.049	0.001	△ 0.075	+ 800	+ 200	+ 1,000		国債補完供給 + 400 CP等買入 △ 200	+ 200			国債補完供給 △ 900 ETF買入 + 400 国債買入 + 9,000	+ 8,500	+ 9,700	+ 3,200,600	+ 2,870,400	+ 2,409,700	▲ 0.297	0.0560	0.030	▲ 0.080	16251.54	38.10	105.47		
10 木	△ 0.050	0.001	△ 0.075	+ 300	△ 40,900	△ 49,600		国債補完供給 + 900 CP等買入 △ 300	+ 600			国債補完供給 △ 100	△ 100	△ 49,100	+ 3,151,500	+ 2,861,300	+ 2,399,400	▲ 0.296	0.0560	0.040	▲ 0.049	17344.42	32.00	105.96		
11 金	△ 0.050	0.001	△ 0.086	+ 100	+ 5,100	+ 5,200		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 800	△ 700			ETF買入 + 700 CP等買入 + 3,000 国債買入 + 4,500	+ 8,200	+ 12,700	+ 3,164,200	+ 2,855,500	+ 2,395,400	▲ 0.277	0.0560	0.045	▲ 0.034	17374.79	33.95	106.93		
14 月	△ 0.053	0.001	△ 0.086	+ 900	△ 24,500	△ 23,600		CP等買入 △ 500 共通担保(全店) △ 2,700	△ 3,200		共通担保(全店) + 1,900	国債補完供給 △ 200 ETF買入 + 300	+ 2,000	△ 24,800	+ 3,139,400	+ 2,839,100	+ 2,382,500	▲ 0.277	0.0560	0.045	▲ 0.020	17672.62	25.27	107.67		
15 火	△ 0.046	0.001	△ 0.075	+ 600	△ 4,000	△ 3,400		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 600	△ 400			国債補完供給 △ 300 ETF買入 + 100 国庫短期証券買入 + 15,000 国債買入 + 11,700	+ 26,500	+ 22,700	+ 3,162,100	+ 2,858,100	+ 2,401,700	▲ 0.277	0.0560	0.050	0.000	17668.15	24.94	108.44		
16 水	△ 0.048	0.001	△ 0.065	+ 0	△ 1,100	△ 1,100		国債補完供給 + 300 CP等買入 △ 100	+ 200			国債補完供給 △ 200 ETF買入 + 900	+ 700	△ 200	+ 3,161,900	+ 2,869,100	+ 942,700	▲ 0.275	0.0560	0.055	0.015	17862.21	27.26	109.50		
17 木	△ 0.045	0.010	△ 0.080	△ 1,000	△ 23,300	△ 24,300		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 100	+ 100			国債補完供給 △ 100 ETF買入 + 300	+ 200	△ 24,000	+ 3,137,900	+ 2,841,000	+ 2,265,000	▲ 0.273	0.0560	0.055	0.005	17862.63	23.70	109.47		
18 金	△ 0.049	0.001	△ 0.086	△ 1,200	+ 1,000	△ 200		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 300	△ 200			国債補完供給 △ 300 ETF買入 + 300 CP等買入 + 3,000 国債買入 + 12,600	+ 15,600	+ 15,200	+ 3,153,100	+ 2,835,200	+ 2,374,500	▲ 0.288	0.0560	0.060	0.035	17967.41	25.41	110.92		
21 月	△ 0.051	0.010	△ 0.085	△ 800	△ 34,700	△ 35,500		国債補完供給 + 300 CP等買入 △ 500 共通担保(全店) △ 1,400	△ 1,600		共通担保(全店) + 1,500	国債補完供給 △ 200	+ 1,300	△ 35,800	+ 3,117,300	+ 2,812,400	+ 2,354,600	▲ 0.290	0.0560	0.055	0.025	18106.02	20.70	111.18		
22 火	△ 0.053	0.001	△ 0.085	△ 1,400	△ 300	△ 1,700		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 200	+ 0			国債補完供給 △ 200 ETF買入 + 400 国庫短期証券買入 + 15,000 国債買入 + 11,600	+ 26,800	+ 25,100	+ 3,142,400	+ 2,829,100	+ 2,379,300	▲ 0.290	0.0560	0.050	0.025	18162.94	19.60	111.24		
24 木	△ 0.054	0.020	△ 0.080	△ 1,600	+ 1,400	△ 200		国債補完供給 + 200 CP等買入 △ 200	+ 0			国債補完供給 △ 100 国債買入 + 4,900	+ 4,800	+ 4,600	+ 3,147,000	+ 2,833,500	+ 2,383,700	▲ 0.290	0.0560	0.060	0.030	18333.41	23.67	113.39		
25 金	△ 0.054	0.001	△ 0.080	△ 800	△ 2,000	△ 2,800		国債補完供給 + 100 社債等買入 △ 200 CP等買入 △ 500	△ 600			国債補完供給 △ 100 ETF買入 + 300 社債等買入 + 1,000	+ 1,200	△ 2,200	+ 3,144,800	+ 2,822,600	+ 2,371,300	▲ 0.300	0.0560	0.060	0.033	18381.22	24.92	113.90		
28 月	△ 0.054	0.001	△ 0.085	△ 500	△ 7,800	△ 8,300		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 200 共通担保全店 △ 2,100	△ 2,200		共通担保(全店) + 3,000	国債補完供給 △ 800 ETF買入 + 100 国債買入 + 12,400	+ 14,700	+ 4,200	+ 3,149,000	+ 2,833,500	+ 2,383,300	▲ 0.301	0.0560	0.060	0.010	18356.89	21.85	112.97		
29 火	△ 0.052	0.001	△ 0.085	△ 1,300	△ 2,000	△ 3,300		国債補完供給 + 800 CP等買入 △ 500	+ 300			国債補完供給 △ 100 国庫短期証券買入 + 10,000	+ 9,900	+ 6,900	+ 3,155,900	+ 2,828,900	+ 2,385,700	▲ 0.321	0.0560	0.050	0.010	18307.04	19.56	112.38		
30 水	△ 0.054	0.001	△ 0.085	△ 1,100	+ 12,500	+ 11,400		国債補完供給 + 100 CP等買入 △ 1,800	△ 1,700			国債補完供給 △ 100 CP等買入 + 3,500 国債買入 + 8,000	+ 11,400	+ 21,100	+ 3,177,000	+ 2,838,800	+ 2,394,000	▲ 0.336	0.0560	0.060	0.015	18308.48	26.71	112.96		
月 中 平 均	△ 0.0492	—	—	△ 4,479	△ 145,355	△ 149,834		国債買入 + 99,554	—	月中実績 + 0	月中実績 △ 149	月中実績 + 7,793	月中実績 + 7,644	—	—	+ 17,468	—	—	—	▲ 0.291	0.056	0.048	▲ 0.009	17734.10	24.58	108.81
月 中 平 均	△ 0.0492	—	—	月末残高 974,298	—	—		国庫短期証券買入 + 60,104	—	月末残高 + 0	月末残高 + 4,671	月末残高 + 601,522	月末残高 + 606,193	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	

\*暦日ベース 基準貸付金利 { 0.75 % (H19. 2.21~ ) 短期ﾌﾞﾗｲﾄﾞ { 1.475 % (H21.1.13~ ) 注1) 日本銀行発表  
0.50 % (H20. 10.31~ ) 長期ﾌﾞﾗｲﾄﾞ { 0.90 % (H28.7.8~ ) 注2) TB642~TB648回債(日本相互証券) 日本経済新聞  
0.30 % (H20. 12.19~ ) 0.95 % (H28.8.10~ ) 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) 344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