

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 28年 (2016年) 12月>

平成 28年 1月 4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12月	*速報ベース		資金過不足				オペエント				オペスター				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	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	3ヵ月	金利生物 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 木	△ 0.051	△ 0.085 0.001	△ 1,800	△ 9,100	△ 10,900		国債補充供給 +100 CP等買入 △200	△ 100				△ 11,000	+ 3,166,000	+ 2,843,600	+ 2,399,300	▲ 0.335	0.0560	0.055	0.030	18513.12	28.21	113.83									
2 金	△ 0.049	△ 0.080 0.001	△ 1,600	△ 72,700	△ 74,300		成長基盤強化支援 △5,200 社債等買入 △200 CP等買入 △200	△ 5,600		成長基盤強化支援 +6,200 国債買入 +11,800	+ 18,000	△ 61,900	+ 3,104,100	+ 2,789,600	+ 2,350,100	▲ 0.392	0.0560	0.060	0.035	18426.08	28.33	114.20									
5 月	△ 0.052	△ 0.085 0.001	△ 500	△ 3,800	△ 4,300		CP等買入 △300 共通担保(全店) △1,500	△ 1,800		共通担保(全店) +1,500 国債補充供給 △1,100	+ 400	△ 5,700	+ 3,098,400	+ 2,768,100	+ 2,328,100	▲ 0.397	0.0560	0.055	0.025	18274.99	20.68	112.87									
6 火	△ 0.054	△ 0.085 0.001	△ 1,400	+ 1,000	△ 400		国債補充供給 +1,100 CP等買入 △400	+ 700		国債補充供給 △500 国庫短期証券買入 +5,000 国債買入 +12,500	+ 17,000	+ 17,300	+ 3,115,700	+ 3,806,400	+ 2,367,700	▲ 0.398	0.0560	0.060	0.045	18360.54	23.91	113.50									
7 水	△ 0.056	△ 0.085 0.001	△ 1,200	+ 300	△ 900		国債補充供給 +500 CP等買入 △100	+ 400		国債買入 +4,100	+ 4,100	+ 3,600	+ 3,119,300	+ 2,799,800	+ 2,363,000	▲ 0.404	0.0560	0.055	0.030	18496.69	24.00	113.94									
8 木	△ 0.053	△ 0.086 0.001	△ 2,400	△ 2,600	△ 5,000		CP等買入 △200	△ 200		国債補充供給 △300	△ 300	△ 5,500	+ 3,113,800	+ 2,801,600	+ 2,366,500	▲ 0.404	0.0560	0.055	0.040	18765.47	28.18	114.02									
9 金	△ 0.050	△ 0.085 0.001	△ 2,200	△ 3,600	△ 5,800		国債補充供給 +300 社債等買入 △200 CP等買入 △500	△ 400		国債補充供給 △100 ETF買入 +700 CP等買入 +4,500 国債買入 +12,800	+ 17,900	+ 11,700	+ 3,125,500	+ 2,810,400	+ 2,372,100	▲ 0.443	0.0560	0.060	0.050	18996.37	31.31	115.16									
12 月	△ 0.052	△ 0.083 0.001	△ 900	△ 29,000	△ 29,900		国債補充供給 +100 CP等買入 △400 共通担保(全店) △2,900	△ 3,200		共通担保(本店) +2,000 国債補充供給 △200 ETF買入 +300	+ 2,100	△ 31,000	+ 3,094,500	+ 2,795,100	+ 2,355,900	▲ 0.443	0.0560	0.060	0.070	19155.03	29.55	114.73									
13 火	△ 0.043	△ 0.070 0.001	△ 2,500	+ 1,000	△ 1,500		国債補充供給 +200 CP等買入 △900	△ 700		国債補充供給 △600 ETF買入 +100 国庫短期証券買入 +12,500 国債買入 +11,300	+ 23,300	+ 21,100	+ 3,115,600	+ 2,798,900	+ 2,362,600	▲ 0.443	0.0560	0.060	0.080	19250.52	23.13	114.87									
14 水	△ 0.034	△ 0.065 0.001	△ 2,000	+ 27,600	+ 25,600		国債補充供給 +600 社債等買入 △100 CP買入 △100	+ 400		国債補充供給 △700 ETF買入 +400	△ 300	+ 25,700	+ 3,141,300	+ 2,815,800	+ 2,378,100	▲ 0.442	0.0560	0.060	0.055	19253.61	20.45	117.01									
15 木	△ 0.029	△ 0.070 0.003	△ 3,400	+ 54,000	+ 50,600		貸出増加支援 △13,000 国債補充供給 +700 CP等買入 △800	△ 13,100		貸出増加支援 +59,800 国債補充供給 △300 ETF買入 +200	+ 59,700	+ 97,200	+ 3,238,500	+ 2,907,200	+ 2,454,700	▲ 0.432	0.0560	0.065	0.075	19273.79	23.24	117.97									
16 金	△ 0.037	△ 0.070 0.001	△ 3,100	+ 3,300	+ 200		国債補充供給 +300 CP等買入 △200	+ 100		国債補充供給 △200 ETF買入 +500 CP等買入 +4,500 国債買入 +16,300	+ 21,100	+ 21,400	+ 3,259,900	+ 2,926,800	+ 2,406,000	▲ 0.398	0.0560	0.065	0.075	19401.15	23.10	116.97									
19 月	△ 0.036	△ 0.070 0.001	△ 2,700	△ 2,900	△ 5,600		国債補充供給 +200 CP等買入 △300 共通担保(全店) △1,500	△ 1,600		共通担保(全店) +1,600 国債補充供給 △100	+ 1,500	△ 5,700	+ 3,254,200	+ 2,930,000	+ 2,460,100	▲ 0.398	0.0560	0.075	0.075	19391.60	17.37	116.99									
20 火	△ 0.032	△ 0.070 0.001	△ 4,800	+ 62,500	+ 57,700		国債補充供給 +100 社債等買入 △1,300 CP等買入 △500	△ 1,700		国債補充供給 △2,300 ETF買入 +100 国債買入 +4,200	+ 2,000	+ 58,000	+ 3,312,200	+ 2,983,200	+ 2,479,200	▲ 0.402	0.0560	0.075	0.065	19494.53	19.29	117.40									
21 水	△ 0.027	△ 0.080 0.001	△ 4,600	△ 3,100	△ 7,700		国債補充供給 +2,300 社債等買入 △100 CP等買入 △600	+ 1,600		国債補充供給 △300 ETF買入 +100 国庫短期証券買入 +12,500 国債買入 +12,400	+ 24,700	+ 18,600	+ 3,330,800	+ 2,986,800	+ 2,487,900	▲ 0.404	0.0560	0.070	0.055	19444.49	21.02	117.41									
22 木	△ 0.028	△ 0.080 0.001	△ 5,300	+ 5,600	+ 300		国債補充供給 +300 社債等買入 △100 CP等買入 △500	△ 300		国債補充供給 △1,100 被災地金融機関支援 +100 社債等買入 +1,300	+ 300	+ 300	+ 3,331,100	+ 2,996,600	+ 2,501,200	▲ 0.448	0.0560	0.070	0.050	19427.67	18.71	117.01									
26 月	△ 0.041	△ 0.100 0.001	△ 2,800	△ 14,100	△ 16,900		国債補充供給 +1,100 ETF買入 △200 CP等買入 △700 共通担保(全店) △2,000	△ 1,800		共通担保(全店) +2,700 国債補充供給 △100 ETF買入 +100	+ 2,700	△ 16,000	+ 3,315,100	+ 2,977,000	+ 2,483,600	▲ 0.447	0.0560	0.075	0.055	19396.64	14.41	117.10									
27 火	△ 0.048	△ 0.070 0.001	△ 2,500	+ 3,000	+ 500		国債補充供給 +100 社債等買入 △100 CP等買入 △1,100	△ 1,100		国債補充供給 △300 ETF買入 +400 国庫短期証券買入 +7,500 国債買入 +4,400	+ 12,000	+ 11,400	+ 3,326,500	+ 2,993,700	+ 2,501,000	▲ 0.447	0.0560	0.075	0.060	19403.06	17.49	117.38									
28 水	△ 0.046	△ 0.070 0.001	△ 2,600	+ 800	△ 1,800		国債補充供給 +300 CP等買入 △1,600	△ 1,300		国債補充供給 △1,400 ETF買入 +800	△ 600	△ 3,700	+ 3,322,800	+ 2,995,800	+ 2,505,700	▲ 0.432	0.0560	0.065	0.055	19401.72	13.11	116.25									
29 木	△ 0.048	△ 0.085 0.001	△ 2,200	△ 11,700	△ 13,900		国債補充供給 +1,400 CP等買入 △500	+ 900		国債補充供給 △200	△ 200	△ 13,200	+ 3,309,600	+ 2,986,200	+ 2,497,300	▲ 0.410	0.0560	0.055	0.040	19145.14	22.49	116.05									
30 金	△ 0.058	△ 0.086 0.001	+ 100	△ 6,900	△ 6,800		国債補充供給 +200 CP等買入 △3,800	△ 3,600		国債補充供給 △6,100 ETF買入 +700 CP等買入 +4,500 国債買入 +4,100	+ 3,200	△ 7,200	+ 3,302,400	+ 2,953,700	+ 2,462,000	▲ 0.391	0.0560	0.060	0.041	19114.37	16.67	117.12									
月 中 平 均	△ 0.0440	—	△ 56,313	△ 973	△ 51,286		国債買入 +94,002	—	月中実績 +0	月中実績 △109	△ 2,810	—	+ 125,290	—	—	▲ 0.420	0.056	0.064	0.055	19128.81	21.48	116.20									
月 中 平 均	△ 0.0430	—	月末残高 1,024,612	—	—		国庫短期証券買入 +37,578	—	月末残高 +0	月末残高 +4,562	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—									

*暦日ベース 基準貸付金利 0.75 % (H19. 2.21~) 短期 フ ラ イ ム 1.475 % (H21.1.13~) 注1) 日本銀行発表
 0.50 % (H20. 10.31~) 長期 フ ラ イ ム 0.90 % (H28.7.8~) 注2) TB648~TB654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) 345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