

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 29年 (2017年) 2月>

平成 29年 3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29年 2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	継続了先	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	金額単位:億円					
1 水	△ 0.054	△ 0.085 0.001	+ 500	△ 5,900	△ 5,400		国債補充供給 + 600 CP等買入 △ 100	+ 500		国債補充供給 △ 1,500	△ 1,500	△ 6,400	+ 3,312,200	+ 2,961,400	+ 2,494,100	▲ 0.289	0.0560	0.070	0.090	19148.08	20.32	112.65						
2 木	△ 0.052	△ 0.085 0.001	+ 100	△ 71,600	△ 71,500		国債補充供給 + 1,500 社債等買入 △ 100	+ 1,400		国債補充供給 △ 2,100	△ 2,100	△ 72,200	+ 3,240,000	+ 2,896,800	+ 2,430,400	▲ 0.289	0.0560	0.065	0.104	18914.58	21.28	112.47						
3 金	△ 0.050	△ 0.085 0.001	+ 300	+ 3,600	+ 3,900		国債補充供給 + 2,100 CP等買入 △ 100	+ 2,000		国債補充供給 △ 1,800 ETF買入 + 100	+ 10,000	+ 15,900	+ 3,255,900	+ 2,910,900	+ 2,444,600	▲ 0.287	0.0560	0.065	0.095	18918.20	21.16	112.51						
6 月	△ 0.046	△ 0.075 0.001	+ 1,500	△ 31,400	△ 28,900		国債補充供給 + 1,800 CP等買入 △ 300 共通担保(全店) △ 1,600	△ 100	共通担保(全店) + 1,600	ETF買入 + 200	+ 1,800	△ 28,200	+ 3,227,700	+ 2,905,800	+ 2,443,900	▲ 0.283	0.0560	0.070	0.100	18976.71	17.97	112.22						
7 火	△ 0.035	△ 0.055 0.001	+ 1,100	+ 4,600	+ 5,700		CP等買入 △ 100	△ 100		国債補充供給 △ 200 ETF買入 + 200 国庫短期証券買入 + 10,000	+ 10,000	+ 28,000	+ 3,255,700	+ 2,927,400	+ 2,468,100	▲ 0.277	0.0560	0.060	0.095	18910.78	16.94	112.15						
8 水	△ 0.028	△ 0.070 0.001	+ 700	+ 1,700	+ 2,400		国債補充供給 + 200 CP等買入 △ 100	+ 100		ETF買入 + 200 国債買入 + 7,500	+ 7,700	+ 10,200	+ 3,265,900	+ 2,946,500	+ 2,487,400	▲ 0.268	0.0560	0.070	0.090	19007.60	16.41	112.04						
9 木	△ 0.027	△ 0.065 0.001	+ 200	△ 9,600	△ 9,400		CP等買入 △ 300	△ 300		国債補充供給 △ 2,400 ETF買入 + 400 CP等買入 + 3,000	+ 1,000	△ 8,700	+ 3,257,200	+ 2,933,700	+ 2,476,600	▲ 0.243	0.0560	0.065	0.080	18907.67	19.33	112.75						
10 金	△ 0.023	△ 0.079 0.001	+ 100	△ 14,000	△ 13,900		国債補充供給 + 2,400 CP等買入 △ 200	+ 2,200		国債補充供給 △ 3,700 ETF買入 + 600 国債買入 + 13,100	+ 10,000	△ 1,700	+ 3,255,500	+ 2,932,900	+ 2,476,000	▲ 0.216	0.0560	0.060	0.080	19378.93	22.42	112.38						
13 月	△ 0.027	△ 0.080 0.001	+ 600	△ 21,000	△ 20,400		国債補充供給 + 3,700 CP等買入 △ 200 共通担保(全店) △ 1,500	+ 2,000	共通担保(全店) + 1,400	国債補充供給 △ 5,400 ETF買入 + 700	△ 3,300	△ 21,700	+ 3,233,800	+ 2,926,900	+ 2,470,000	▲ 0.221	0.0560	0.065	0.085	19459.15	18.80	113.49						
14 火	△ 0.026	△ 0.080 0.001	+ 100	+ 300	+ 400		国債補充供給 + 5,400 CP等買入 △ 300	+ 5,100		ETF買入 + 600 国庫短期証券買入 + 15,000 国債買入 + 11,900	+ 17,400	+ 22,900	+ 3,256,700	+ 2,929,200	+ 2,470,700	▲ 0.221	0.0560	0.075	0.090	19238.98	21.04	113.26						
15 水	△ 0.026	△ 0.080 0.001	△ 500	+ 57,300	+ 56,800		国債補充供給 + 10,100 CP等買入 △ 1,300	+ 8,800		国債補充供給 △ 7,600 ETF買入 + 400	△ 7,200	+ 58,400	+ 3,315,100	+ 2,973,500	+ 2,500,700	▲ 0.219	0.0560	0.070	0.085	19437.98	21.04	114.24						
16 木	△ 0.045	△ 0.080 0.001	△ 700	△ 30,400	△ 31,100		国債補充供給 + 7,600 CP等買入 △ 200	+ 7,400		国債補充供給 △ 300 ETF買入 + 400	+ 100	△ 23,600	+ 3,291,500	+ 2,967,800	+ 2,139,300	▲ 0.223	0.0560	0.065	0.090	19347.53	20.27	114.59						
17 金	△ 0.047	△ 0.080 0.001	△ 1,100	+ 800	△ 300		国債補充供給 + 300 CP等買入 △ 200	+ 100		国債補充供給 △ 200 CP等買入 + 3,000 国債買入 + 12,800	+ 15,600	+ 15,400	+ 3,306,900	+ 2,978,500	+ 2,493,700	▲ 0.268	0.0560	0.060	0.085	19234.62	20.29	113.18						
20 月	△ 0.046	△ 0.100 0.001	△ 400	△ 31,000	△ 31,400		国債補充供給 + 200 CP等買入 △ 300 共通担保(全店) △ 1,600	△ 1,700	共通担保(全店) + 1,500	国債補充供給 △ 300 ETF買入 + 200	+ 1,400	△ 31,700	+ 3,275,200	+ 2,947,500	+ 2,465,100	▲ 0.269	0.0560	0.060	0.090	19251.08	14.97	112.79						
21 火	△ 0.042	△ 0.075 0.001	△ 500	+ 3,500	+ 3,000		国債補充供給 + 300 CP等買入 △ 200	+ 100		国債補充供給 △ 200 ETF買入 + 100 国庫短期証券買入 + 10,000	+ 14,400	+ 17,500	+ 3,292,700	+ 2,956,200	+ 2,483,700	▲ 0.269	0.0560	0.060	0.090	19381.44	15.28	113.11						
22 水	△ 0.036	△ 0.075 0.001	△ 1,200	+ 100	△ 1,100		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 △ 700	△ 700	△ 1,800	+ 3,290,900	+ 2,952,200	+ 2,483,600	▲ 0.269	0.0560	0.060	0.080	19379.87	21.74	113.71						
23 木	△ 0.032	△ 0.070 0.001	△ 1,800	△ 6,300	△ 8,100		国債補充供給 + 700 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 300	+ 300		国債補充供給 △ 500 社債等買入 + 800	+ 300	△ 7,500	+ 3,283,400	+ 2,951,500	+ 2,483,000	▲ 0.297	0.0560	0.060	0.074	19371.46	19.61	113.08						
24 金	△ 0.033	△ 0.075 0.001	△ 1,700	△ 600	△ 2,300		国債補充供給 + 500 社債等買入 △ 400 CP等買入 △ 900	△ 800		国債補充供給 △ 300 国債買入 + 13,100	+ 12,800	+ 9,700	+ 3,293,100	+ 2,950,400	+ 2,481,600	▲ 0.329	0.0560	0.060	0.060	19283.54	21.12	112.60						
27 月	△ 0.039	△ 0.080 0.001	△ 500	△ 14,400	△ 14,900		国債補充供給 + 300 CP等買入 △ 200 共通担保(全店) △ 1,400	△ 1,300	共通担保(全店) + 1,400	国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 200	+ 1,500	△ 14,700	+ 3,278,400	+ 2,933,200	+ 2,466,100	▲ 0.329	0.0560	0.055	0.046	19107.47	18.38	111.92						
28 火	△ 0.048	△ 0.080 0.001	△ 700	+ 8,000	+ 7,300		国債補充供給 + 100 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 3,400	△ 3,400		国債補充供給 △ 2,300 ETF買入 + 200 CP等買入 + 3,000 国庫短期証券買入 + 5,000 国債買入 + 8,500	+ 14,400	+ 18,300	+ 3,296,700	+ 2,937,700	+ 2,474,200	▲ 0.327	0.0560	0.060	0.050	19118.99	19.84	112.26						
月 中 平 均	△ 0.0381	—	△ 3,765	△ 156,449	△ 160,214	—	国債買入 + 95,523	—	月中実績 + 0	月中実績 △ 145	+ 2,653	—	—	—	—	▲ 0.270	0.056	0.064	0.083	19188.73	19.41	113.05						
月 中 平 均	△ 0.0380	—	月末残高 993,224	—	—	—	国庫短期証券買入 + 40,072	—	月末残高 + 0	月末残高 + 3,196	+ 557,770	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—					

* 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 フ ラ イ ム { 1.475 % (H21.1.13~) 0.90 % (H28.7.8~) } 長期 フ ラ イ ム { 0.95 % (H28.8.10~) }

注1) 日本銀行発表 注2) TB660~TB666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) 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