

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 29年 (2017年) 3月>

平成 29年 4月 3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3月	*速報ベース		資金過不足				オペエント		オバスター				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	計	日銀当預 増減	日銀当預 残高	準備預金 残高	繰上先	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			
1 水	△ 0.046	△ 0.078	△ 600	△ 13,300	△ 13,900		国債補充供給 CP等買入	+ 2,300 △ 500	+ 1,800		国債補充供給 ETF買入 国債買入	△ 100 + 1,200 + 9,000	+ 10,100	△ 2,000	+ 3,294,700	+ 2,942,400	+ 2,479,900	▲ 0.316	0.0560	0.060	0.060	19393.54	19.93	113.66	
2 木	△ 0.042	△ 0.076	△ 1,100	△ 47,400	△ 48,500		国債補充供給 社債等買入 CP等買入	+ 100 △ 100 △ 100	△ 100		ETF買入	+ 400	+ 400	△ 48,200	+ 3,246,500	+ 2,899,900	+ 2,439,500	▲ 0.335	0.0560	0.060	0.080	19564.80	22.10	114.21	
3 金	△ 0.037	△ 0.074	△ 300	△ 5,000	△ 5,300		成長基盤支援基金 CP等買入	△ 2,700 △ 300	△ 3,000		成長基盤強化支援 国債補充供給 国債買入	+ 5,600 △ 1,100 + 7,500	+ 12,000	+ 3,700	+ 3,250,200	+ 2,902,300	+ 2,443,300	▲ 0.401	0.0560	0.055	0.070	19469.17	17.17	114.48	
6 月	△ 0.038	△ 0.078	+ 1,000	△ 5,100	△ 4,100		国債補充供給 CP等買入 共通担保(全店)	+ 1,100 △ 600 △ 1,600	△ 1,100		国債補充供給 ETF買入	△ 600 + 300	+ 1,300	△ 3,900	+ 3,246,300	+ 2,900,900	+ 2,443,000	▲ 0.408	0.0560	0.055	0.070	19379.14	14.08	114.13	
7 火	△ 0.035	△ 0.080	+ 700	+ 2,000	+ 2,700		国債補充供給 CP等買入	+ 600 △ 500	+ 100		国債補充供給 国庫短期証券買入 国債買入	△ 500 + 2,500 + 8,000	+ 10,000	+ 12,800	+ 3,259,100	+ 2,924,700	+ 2,465,000	▲ 0.406	0.0560	0.055	0.065	19344.15	15.75	114.07	
8 水	△ 0.032	△ 0.065	+ 400	+ 5,900	+ 6,300		国債補充供給 CP等買入	+ 500 △ 200	+ 300		国債補充供給 ETF等買入	△ 1,600 + 700	△ 900	+ 5,700	+ 3,264,800	+ 2,920,500	+ 2,461,100	▲ 0.394	0.0560	0.060	0.070	19254.03	16.26	114.02	
9 木	△ 0.027	△ 0.060	△ 200	△ 300	△ 500		国債補充供給 CP等買入	+ 1,600 △ 300	+ 1,300		国債補充供給	△ 400	△ 400	+ 400	+ 3,265,200	+ 2,923,700	+ 2,464,900	▲ 0.395	0.0560	0.060	0.085	19318.58	15.90	114.60	
10 金	△ 0.029	△ 0.075	+ 100	+ 1,300	+ 1,400		国債補充供給 CP等買入	+ 400 △ 100	+ 300		国債補充供給 ETF買入 CP等買入 国債買入	△ 300 + 600 + 5,000 + 8,000	+ 13,300	+ 15,000	+ 3,280,200	+ 2,955,100	+ 2,496,700	▲ 0.380	0.0560	0.055	0.085	19604.61	22.67	115.46	
13 月	△ 0.048	△ 0.080	+ 1,200	△ 16,700	△ 15,500		国債補充供給 社債等買入 CP等買入 共通担保(全店)	+ 300 △ 100 △ 600 △ 1,400	△ 1,800		共通担保(全店) 国債補充供給	+ 1,300 △ 500	+ 800	△ 16,500	+ 3,263,700	+ 2,945,600	+ 2,489,000	▲ 0.377	0.0560	0.060	0.085	19633.75	14.71	114.92	
14 火	△ 0.053	△ 0.083	+ 200	+ 3,000	+ 3,200		国債補充供給 CP等買入	+ 500 △ 100	+ 400		国債補充供給 国庫短期証券買入 国債買入	△ 2,700 + 2,500 + 10,300	+ 10,100	+ 13,700	+ 3,277,400	+ 2,955,900	+ 2,500,600	▲ 0.343	0.0560	0.060	0.085	19609.50	17.58	115.18	
15 水	△ 0.046	△ 0.080	△ 400	△ 14,700	△ 15,100		国債補充供給 CP等買入	+ 2,700 △ 1,400	+ 1,300		国債補充供給 国債買入	△ 1,800 + 5,300	+ 3,500	△ 10,300	+ 3,267,100	+ 2,946,400	+ 2,492,100	▲ 0.328	0.0560	0.060	0.090	19577.38	16.50	114.88	
16 木	△ 0.043	△ 0.080	△ 900	+ 1,700	+ 800		国債補充供給 CP等買入	+ 1,800 △ 200	+ 1,600		国債補充供給 ETF買入	△ 1,500 + 300	△ 1,200	+ 1,200	+ 3,268,300	+ 2,935,700	+ 1,345,000	▲ 0.331	0.0560	0.055	0.070	19590.14	17.96	113.55	
17 金	△ 0.039	△ 0.080	△ 1,400	+ 5,300	+ 3,900		貸出増加支援 国債補充供給 社債等買入 CP等買入	△ 31,700 + 1,500 △ 400 △ 600	△ 31,200		貸出増加支援 国債補充供給 国債買入	+ 75,200 △ 4,400 + 10,400	+ 81,200	+ 53,900	+ 3,322,200	+ 2,981,400	+ 2,512,900	▲ 0.336	0.0560	0.060	0.070	19521.59	20.13	113.49	
21 火	△ 0.042	△ 0.075	+ 300	+ 54,900	+ 55,200		国債補充供給 CP等買入 共通担保(全店)	+ 4,400 △ 1,100 △ 1,500	+ 1,800		共通担保(全店) 国債補充供給	+ 3,100 △ 4,300	+ 3,100	△ 1,200	+ 55,800	+ 3,378,000	+ 3,043,600	+ 2,531,300	▲ 0.336	0.0560	0.060	0.060	19455.88	15.97	112.85
22 水	△ 0.039	△ 0.075	+ 200	△ 6,100	△ 5,900		国債補充供給 社債等買入 CP等買入	+ 4,300 △ 100 △ 400	+ 3,800		国債補充供給 ETF買入 国庫短期証券買入	△ 3,600 + 500 + 5,000	+ 1,900	△ 200	+ 3,377,800	+ 3,024,600	+ 2,513,700	▲ 0.336	0.0560	0.055	0.055	19041.38	20.55	111.79	
23 木	△ 0.037	△ 0.070	△ 1,300	+ 800	△ 500		国債補充供給 CP等買入	+ 3,600 △ 300	+ 3,300		国債補充供給 CP等買入 国債買入	△ 3,200 + 5,000 + 11,600	+ 13,400	+ 16,200	+ 3,394,000	+ 3,043,100	+ 2,534,500	▲ 0.326	0.0560	0.060	0.050	19085.31	17.59	111.58	
24 金	△ 0.039	△ 0.078	△ 700	+ 300	△ 400		国債補充供給 CP等買入	+ 3,200 △ 600	+ 2,600		国債補充供給	△ 3,300	△ 3,300	△ 1,100	+ 3,392,900	+ 3,051,400	+ 2,541,200	▲ 0.314	0.0560	0.060	0.060	19262.53	18.21	111.48	
27 月	△ 0.044	△ 0.080	+ 300	+ 20,200	+ 20,500		国債補充供給 CP等買入 共通担保(全店)	+ 3,300 △ 1,300 △ 1,300	+ 700		共通担保(全店) 国債補充供給 国債買入	+ 3,900 △ 10,000 + 4,100	+ 3,900	△ 8,900	+ 16,200	+ 3,409,100	+ 3,047,300	+ 2,537,900	▲ 0.308	0.0560	0.055	0.055	18985.59	17.62	110.98
28 火	△ 0.047	△ 0.075	△ 300	+ 6,200	+ 5,900		国債補充供給 CP等買入	+ 3,000 △ 500	+ 2,500		国債補充供給 ETF買入	△ 2,200 + 600	△ 1,600	+ 6,800	+ 3,415,900	+ 3,069,700	+ 2,566,600	▲ 0.291	0.0560	0.060	0.055	19202.87	19.00	110.83	
29 水	△ 0.046	△ 0.070	△ 500	△ 2,300	△ 2,800		国債補充供給 CP等買入	+ 2,200 △ 300	+ 1,900		国債補充供給 ETF買入 社債等買入	△ 2,600 + 700 + 1,000	△ 900	△ 1,800	+ 3,414,100	+ 3,073,400	+ 2,572,600	▲ 0.266	0.0560	0.055	0.050	19217.48	17.51	111.31	
30 木	△ 0.046	△ 0.078	△ 1,100	+ 21,600	+ 20,500		国債補充供給 CP等買入	+ 2,600 △ 1,000	+ 1,600		国債補充供給 ETF買入	△ 4,800 + 600	△ 4,200	+ 17,900	+ 3,432,000	+ 3,088,600	+ 2,586,500	▲ 0.238	0.0560	0.055	0.060	19063.22	18.49	111.42	
31 金	△ 0.060	△ 0.086	△ 300	+ 6,600	+ 6,300		貸出増加支援 国債補充供給 CP等買入	△ 300 + 4,800 △ 8,100	△ 3,600		国債補充供給 国債買入 ETF買入 CP等買入	△ 24,200 + 11,400 + 300 + 6,000	△ 17,900	△ 3,800	+ 3,428,200	+ 3,075,600	+ 2,566,500	▲ 0.196	0.0560	0.050	0.065	18909.26	22.22	112.21	
月平均	△ 0.0416	—	△ 4,777	+ 18,745	+ 13,965		国債買入	+ 85,664	—	月中実績	+ 0	—	—	—	+ 131,323	—	—	—	▲ 0.335	0.056	0.058	0.068	19340.18	18.09	113.00
月平均	△ 0.0400	—	月末残高 998,001	—	—		国庫短期証券買入	+ 10,029	—	月末実績	+ 4,134	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

*暦日ベース
基準貸付金利 0.75 % (H19. 2.21~)
0.50 % (H20. 10.31~)
0.30 % (H20. 12.19~)

短期プライム 1.475 % (H21.1.13~)
長期プライム 0.90 % (H28.7.8~)
0.95 % (H28.8.19~)

注1) 日本銀行発表
注2) TB666~TB672回債(日本相互証券)日本経済新聞
注3) TBOR(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) 346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