

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 29年 (2017年) 6月>

平成 29年 7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6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	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	金額単位:億円			
1 木	△ 0.060	△ 0.086 0.001	△ 100	△ 13,100	△ 13,200		国債補充供給 + 600 CP等買入 △ 200	+ 400		国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 100	+ 0	△ 12,800	+ 3,504,100	+ 3,151,800	+ 3,151,300	▲ 0.121	0.0560	0.045	0.050	19860.03	17.38			110.72	111.09	
2 金	△ 0.059	△ 0.086 0.001	+ 200	△ 49,300	△ 49,100		成長基盤強化支援 △ 3,800 国債補充供給 + 100 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 100	△ 3,900		成長基盤強化支援 + 8,600 国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 300 国債買入 + 9,100	+ 17,900	△ 35,100	+ 3,469,000	+ 3,123,500	+ 3,122,800	▲ 0.118	0.0560	0.040	0.049	20177.28	23.15			111.71	110.31	
5 月	△ 0.058	△ 0.086 0.001	+ 1,200	+ 3,600	+ 4,800		成長基盤強化支援 △ 100 国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 900 共通担保(全店) △ 1,800	△ 2,700		共通担保(全店) + 2,000 国債補充供給 △ 200	+ 1,800	+ 3,900	+ 3,472,900	+ 3,132,100	+ 3,131,900	▲ 0.118	0.0560	0.040	0.045	20170.82	16.48			110.73	109.57	
6 火	△ 0.057	△ 0.086 0.001	+ 1,200	+ 2,800	+ 4,000		国債補充供給 + 200 CP等買入 △ 800	△ 600		国債補充供給 △ 500 国庫短期証券買入 + 5,000 国債買入 + 11,500	+ 16,000	+ 19,400	+ 3,492,300	+ 3,147,200	+ 3,147,000	▲ 0.116	0.0560	0.040	0.040	19979.90	17.04			110.50	109.22	
7 水	△ 0.056	△ 0.086 0.001	+ 300	+ 4,000	+ 4,300		国債補充供給 + 500 CP等買入 △ 200	+ 300		国債補充供給 △ 100	△ 100	+ 4,500	+ 3,496,800	+ 3,152,600	+ 3,152,500	▲ 0.103	0.0560	0.040	0.040	19984.62	17.18			109.63	109.38	
8 木	△ 0.055	△ 0.086 0.001	△ 100	+ 900	+ 800		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 300	△ 200		国債補充供給 △ 100	△ 100	+ 500	+ 3,497,300	+ 3,154,100	+ 3,154,000	▲ 0.095	0.0560	0.040	0.065	19909.26	19.83			110.01	109.83	
9 金	△ 0.053	△ 0.086 0.001	+ 0	△ 2,700	△ 2,700		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 500	△ 400		国債補充供給 △ 300 ETF買入 + 600 CP等買入 + 3,500 国債買入 + 8,500	+ 12,300	+ 9,200	+ 3,506,500	+ 3,147,900	+ 3,147,800	▲ 0.104	0.0560	0.035	0.050	20013.26	22.63			110.47	110.16	
12 月	△ 0.054	△ 0.086 0.001	+ 600	△ 10,300	△ 9,700		国債補充供給 + 300 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 800 共通担保(全店) △ 2,900	△ 3,500		共通担保(全店) + 2,800 国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 200	+ 2,900	△ 10,300	+ 3,496,200	+ 3,143,500	+ 3,143,300	▲ 0.111	0.0560	0.040	0.055	19908.58	17.85			110.44	109.83	
13 火	△ 0.054	△ 0.086 0.001	△ 100	+ 3,100	+ 3,000		国債補充供給 + 100 社債等買入 △ 400 CP等買入 △ 600	△ 900		国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 100 国庫短期証券買入 + 7,500 国債買入 + 9,200	+ 16,700	+ 18,800	+ 3,515,000	+ 3,155,400	+ 3,155,100	▲ 0.111	0.0560	0.040	0.060	19898.75	16.14			110.27	109.96	
14 水	△ 0.055	△ 0.085 0.001	+ 0	△ 1,000	△ 1,000		国債補充供給 + 100 被災地金融機関 △ 900 CP等買入 △ 500	△ 1,300		国債補充供給 △ 100 被災地金融機関支援 + 900	+ 800	△ 1,500	+ 3,513,500	+ 3,160,200	+ 3,160,200	▲ 0.104	0.0560	0.040	0.060	19883.52	17.01			110.20	109.28	
15 木	△ 0.052	△ 0.075 0.001	△ 900	+ 51,100	+ 50,200		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 1,000	△ 900		国債補充供給 △ 200	△ 200	+ 49,100	+ 3,562,600	+ 3,211,700	+ 3,211,700	▲ 0.104	0.0560	0.035	0.050	19831.82	18.81			109.80	110.85	
16 金	△ 0.060	△ 0.080 0.001	△ 1,300	+ 3,500	+ 2,200		国債補充供給 + 200 社債等買入 △ 200 CP等買入 △ 300	△ 300		国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 700 国債買入 + 8,100	+ 8,700	+ 10,600	+ 3,573,200	+ 3,195,100	+ 3,158,500	▲ 0.103	0.0560	0.035	0.050	19943.26	22.85			111.38	110.79	
19 月	△ 0.058	△ 0.086 0.001	△ 300	△ 7,100	△ 7,400		国債補充供給 + 100 共通担保(全店) △ 2,000 CP等買入 △ 100	△ 2,000		共通担保(全店) + 1,800 国債補充供給 △ 300 CP等買入 + 3,500 ETF買入 + 700 国債買入 + 6,900	+ 7,300	+ 3,200	+ 3,576,400	+ 3,207,500	+ 3,188,900	▲ 0.102	0.0560	0.040	0.050	20067.75	14.84			111.20	111.54	
20 火	△ 0.055	△ 0.086 0.001	△ 1,000	+ 28,500	+ 27,500		貸出増加支援 △ 21,200 国債補充供給 + 300 ETF等買入 △ 700 CP等買入 △ 500	△ 22,100		貸出基盤強化支援 + 26,400 国債補充供給 △ 100	+ 26,300	+ 31,700	+ 3,608,100	+ 3,216,000	+ 3,210,200	▲ 0.101	0.0560	0.030	0.050	20230.41	18.36			111.79	111.08	
21 水	△ 0.056	△ 0.086 0.001	△ 1,300	△ 2,500	△ 3,800		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 200	△ 100		国債補充供給 △ 300 国庫短期証券買入 + 10,000	+ 9,700	+ 5,800	+ 3,613,900	+ 3,227,200	+ 3,223,200	▲ 0.097	0.0560	0.040	0.054	20138.79	16.34			111.48	110.95	
22 木	△ 0.055	△ 0.086 0.001	△ 1,500	△ 8,500	△ 10,000		国債補充供給 + 300 CP等買入 △ 400	△ 100		国債補充供給 △ 100	△ 100	△ 10,200	+ 3,603,700	+ 3,230,500	+ 3,228,200	▲ 0.093	0.0560	0.040	0.050	20110.51	15.50			111.43	111.22	
23 金	△ 0.051	△ 0.080 0.001	△ 1,600	+ 4,600	+ 3,000		国債補充供給 + 100 社債等買入 △ 200 CP等買入 △ 700	△ 800		国債補充供給 △ 300 国債買入 + 10,400	+ 10,100	+ 12,300	+ 3,616,000	+ 3,235,100	+ 3,234,100	▲ 0.097	0.0560	0.035	0.050	20132.67	15.32			111.43	111.21	
26 月	△ 0.053	△ 0.080 0.001	△ 400	△ 10,700	△ 11,100		共通担保(全店) △ 2,600 CP等買入 △ 400 国債補充供給 + 300	△ 2,700		共通担保(全店) + 1,300 国債補充供給 △ 200 社債等買入 + 1,500	+ 1,300	△ 11,200	+ 3,604,800	+ 3,223,500	+ 3,222,400	▲ 0.095	0.0560	0.035	0.050	20153.35	13.95			111.50	111.54	
27 火	△ 0.050	△ 0.078 0.001	△ 900	+ 1,700	+ 800		国債補充供給 + 200 CP等買入 △ 200	+ 0		国債補充供給 △ 400 ETF買入 + 700 国庫短期証券買入 + 7,500 国債買入 + 9,000	+ 16,800	+ 17,600	+ 3,622,400	+ 3,242,300	+ 3,240,800	▲ 0.095	0.0560	0.035	0.045	20225.09	15.73			112.07	112.04	
28 水	△ 0.051	△ 0.078 0.001	△ 600	△ 2,200	△ 2,800		国債補充供給 + 400 CP等買入 △ 300	+ 100		国債補充供給 △ 300 国債買入 + 5,500	+ 5,200	+ 2,500	+ 3,624,900	+ 3,232,500	+ 3,231,400	▲ 0.093	0.0560	0.035	0.054	20130.41	19.20			112.42	112.14	
29 木	△ 0.053	△ 0.078 0.001	△ 1,200	+ 2,100	+ 900		国債補充供給 + 300 CP等買入 △ 900	△ 600		国債補充供給 △ 100	△ 100	+ 200	+ 3,625,100	+ 3,236,900	+ 3,236,000	▲ 0.089	0.0560	0.040	0.055	20220.30	19.50			112.58	111.73	
30 金	△ 0.069	△ 0.086 0.001	△ 700	△ 200	△ 900		国債補充供給 + 100 国債補充供給 + 100 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 5,000	△ 4,900		国債補充供給 △ 2,000 ETF買入 + 500 CP等買入 + 3,500 国債買入 + 9,100	+ 11,100	+ 4,400	+ 3,629,500	+ 3,196,000	+ 3,195,900	▲ 0.095	0.0560	0.035	0.084	2033.43	19.68			112.15		
月 中 平 均	△ 0.0556		△ 8,483	△ 2,063	△ 10,546		国債買入 △ 87,352		月中実績 + 0	月中実績 △ 1,420		月中実績 △ 2,790				▲ 0.103	0.056	0.038	0.053	19227.45	17.94			110.89		
月 中 平 均	△ 0.0560		1,003,636				国庫短期証券買入 + 30,034		月末残高 + 0	月末残高 + 3,490		月末残高 + 486,428														

\*速報ベース

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~ )

長期 フ ラ イ ム

0.90 % (H28.7.8~ )  
0.95 % (H28.8.10~ )

注1) 日本銀行発表

注2) TB685~TB692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 公式計算 日本経済新聞

注5) 347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