

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 29年 (2017年) 10月>

平成 29年 11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10月	*連動ベース		資金過不足				オペランド			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	過不足尻	貸出	CP・国債 手形・共通担保金供給オペ	計(△)	貸出	手形・共通担保金供給オペ	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	繰終了先	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	利 率 : %				
2月	△ 0.047	0.001	+ 600	△ 13,100	△ 12,500		国債補充供給 + 3,900 CP等買入 △ 400 共通担保(全店) △ 4,300	△ 800	共通担保(全店) + 2,300	国債補充供給 △ 100 国庫短期証券買入 + 7,500 国債買入 + 7,200	+ 2,200	△ 11,100	+ 3,680,600	+ 3,244,300	+ 3,243,500	▲ 0.172	0.0560	0.055	0.070	20400.78	13.55							112.54
3火	△ 0.043	0.001	+ 400	△ 7,500	△ 7,100		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 100	+ 0		国債補充供給 △ 100 国庫短期証券買入 + 7,500 国債買入 + 7,200	+ 14,600	+ 7,500	+ 3,688,100	+ 3,259,400	+ 3,259,000	▲ 0.172	0.0560	0.060	0.070	20614.07	14.50							113.19
4水	△ 0.035	0.001	+ 200	△ 34,000	△ 33,800		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 200	△ 100		国債補充供給 △ 100 国債買入 + 100	△ 100	△ 34,000	+ 3,654,100	+ 3,224,600	+ 3,224,100	▲ 0.172	0.0560	0.060	0.050	20626.66	16.60							112.89
5木	△ 0.032	0.001	△ 1,000	△ 19,800	△ 20,800		国債補充供給 +100 CP等買入 △ 300	△ 200		国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 100	+ 0	△ 21,000	+ 3,633,100	+ 3,208,600	+ 3,208,200	▲ 0.175	0.0630	0.065	0.040	20628.56	13.78							112.62
6金	△ 0.028	0.001	△ 600	△ 2,500	△ 3,100		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 200	△ 100		国債補充供給 △ 300 国債買入 + 10,100	+ 9,800	+ 6,600	+ 3,639,700	+ 3,219,600	+ 3,219,400	▲ 0.171	0.0630	0.065	0.050	20690.71	14.59							112.76
10火	△ 0.029	0.001	+ 800	△ 25,300	△ 24,500		国債補充供給 + 300 CP等買入 △ 500 共通担保(全店) △ 2,400	△ 2,600	共通担保(全店) + 2,000	国債補充供給 △ 300 国債買入 + 10,000 国債買入 + 7,200	+ 1,700	△ 25,400	+ 3,614,300	+ 3,211,900	+ 3,211,700	▲ 0.171	0.0630	0.070	0.055	20823.51	14.85							112.82
11水	△ 0.024	0.001	+ 1,100	+ 1,600	+ 2,700		国債補充供給 + 300 CP等買入 △ 300	+ 0		国債補充供給 △ 800 ETF買入 + 800 CP等買入 + 3,000 国庫短期証券買入 + 10,000 国債買入 + 7,200	+ 20,200	+ 22,900	+ 3,637,200	+ 3,233,000	+ 3,232,800	▲ 0.171	0.0630	0.070	0.060	20881.27	15.31							112.58
12木	△ 0.021	0.001	△ 700	+ 3,300	+ 2,600		国債補充供給 + 800 CP等買入 △ 300	+ 500		国債買入 + 6,900	+ 6,900	+ 10,000	+ 3,647,200	+ 3,233,500	+ 3,233,400	▲ 0.171	0.0630	0.070	0.060	20954.72	15.36							112.21
13金	△ 0.021	0.001	△ 200	+ 63,900	+ 63,700		CP等買入 △ 600	△ 600		国債補充供給 △ 700 ETF買入 + 700	+ 0	+ 63,100	+ 3,710,300	+ 3,289,900	+ 3,289,900	▲ 0.183	0.0630	0.070	0.060	21155.18	18.47							111.86
16月	△ 0.043	0.001	+ 600	△ 17,900	△ 17,300		国債補充供給 + 700 CP等買入 △ 300 共通担保(全店) △ 2,300	△ 1,900	共通担保(全店) + 1,400	国債補充供給 △ 700 ETF買入 + 600 国債買入 + 7,800	+ 9,100	△ 10,100	+ 3,700,200	+ 3,274,300	+ 2,001,400	▲ 0.185	0.0630	0.070	0.060	21255.56	18.01							111.66
17火	△ 0.043	0.050	+ 200	△ 5,700	△ 5,500		国債補充供給 + 700 CP等買入 △ 100	+ 600		国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 100 CP等買入 + 3,000 国庫短期証券買入 + 7,500	+ 10,500	+ 5,600	+ 3,705,800	+ 3,275,000	+ 3,159,700	▲ 0.185	0.0630	0.070	0.065	21336.12	15.93							112.04
18水	△ 0.041	0.001	△ 200	+ 2,700	+ 2,500		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 100	+ 0	共通担保(全店) + 100	国債補充供給 △ 400 国債買入 + 10,000	+ 9,700	+ 12,200	+ 3,718,000	+ 3,280,300	+ 3,232,900	▲ 0.183	0.0630	0.065	0.065	21363.05	13.57							112.30
19木	△ 0.042	0.050	△ 1,000	△ 8,400	△ 9,400		国債補充供給 + 400 CP等買入 △ 100 共通担保(全店) △ 100	+ 200		国債補充供給 △ 700 ETF買入 + 600 国債買入 + 7,800	+ 9,100	△ 10,100	+ 3,700,200	+ 3,274,300	+ 2,001,400	▲ 0.185	0.0630	0.070	0.060	21255.56	18.01							112.08
20金	△ 0.041	0.001	△ 1,100	△ 8,500	△ 9,600		国債補充供給 + 400 被災地金融機関支援 △ 200 CP等買入 △ 400	△ 200		国債補充供給 △ 100 ETF買入 + 100 CP等買入 + 3,000 国庫短期証券買入 + 7,500	+ 10,500	+ 5,600	+ 3,705,800	+ 3,275,000	+ 3,159,700	▲ 0.185	0.0630	0.070	0.065	21336.12	15.93							112.30
23月	△ 0.042	0.001	△ 100	△ 20,300	△ 20,400		国債補充供給 + 1,500 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 100 共通担保(全店) △ 2,000	△ 700	共通担保(全店) + 1,600	国債補充供給 △ 100 国庫短期証券買入 + 5,000 国債買入 + 10,000	+ 15,000	△ 19,600	+ 3,681,700	+ 3,252,800	+ 3,250,100	▲ 0.208	0.0630	0.065	0.065	21696.65	15.82							112.14
24火	△ 0.041	0.001	△ 900	△ 2,600	△ 3,500		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 200	△ 100		国債補充供給 △ 400 国債買入 + 10,000	+ 9,700	+ 12,200	+ 3,718,000	+ 3,280,300	+ 3,232,900	▲ 0.183	0.0630	0.065	0.065	21363.05	13.57							112.53
25水	△ 0.041	0.001	△ 800	+ 8,800	+ 8,000		社債等買入 △ 200 CP等買入 △ 200	△ 400		国債補充供給 △ 400 社債等買入 + 1,000	+ 600	+ 8,200	+ 3,701,300	+ 3,266,700	+ 3,266,000	▲ 0.193	0.0630	0.065	0.065	21707.62	19.68							112.63
26木	△ 0.041	0.001	△ 1,700	△ 3,600	△ 5,300		国債補充供給 + 400 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 300	+ 0		国債補充供給 △ 400 社債等買入 + 1,000	+ 600	+ 8,200	+ 3,701,300	+ 3,266,700	+ 3,266,000	▲ 0.193	0.0630	0.065	0.065	21707.62	19.68							113.35
27金	△ 0.039	0.001	△ 2,000	+ 4,600	+ 2,600		CP等買入 △ 200	△ 200		国債補充供給 △ 400 社債等買入 + 1,000	+ 600	+ 8,200	+ 3,701,300	+ 3,266,700	+ 3,266,000	▲ 0.193	0.0630	0.065	0.065	21707.62	19.68							113.80
30月	△ 0.040	0.001	+ 0	△ 12,500	△ 12,500		社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 500 共通担保(全店) △ 1,400	△ 2,000	共通担保(全店) + 1,300	国債補充供給 △ 100 国庫短期証券買入 + 5,000 国債買入 + 10,000	+ 15,000	△ 19,600	+ 3,681,700	+ 3,252,800	+ 3,250,100	▲ 0.208	0.0630	0.065	0.065	21696.65	15.82							113.99
31火	△ 0.046	0.001	△ 800	△ 1,000	△ 1,800		国債補充供給 + 200 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 700	△ 600		国債補充供給 △ 600 CP等買入 + 3,000 国庫短期証券買入 + 2,500 国債買入 + 7,500	+ 12,400	+ 10,000	+ 3,704,100	+ 3,257,600	+ 3,257,300	▲ 0.200	0.0630	0.070	0.065	22011.61	18.88							114.31
月 中	△ 0.0371	—	—	△ 98,238	△ 105,300	—	国債買入 + 79,999	—	—	国債買入 + 9,100	+ 9,100	+ 11,500	+ 3,707,500	+ 3,268,100	+ 3,267,200	▲ 0.200	0.0630	0.070	0.065	22008.45	19.91							113.53
平 均	△ 0.0324	—	△ 7,062	—	—	—	国庫短期証券買入 + 32,549	—	—	国債買入 + 9,100	+ 9,100	+ 11,500	+ 3,707,500	+ 3,268,100	+ 3,267,200	▲ 0.200	0.0630	0.070	0.065	22008.45	19.91							113.75
月 中	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	113.98
平 均	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	113.83

*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

長期プライム

1.475 % (H21.1.13~)
0.95 % (H28.8.10~)
1.00 % (H29.7.11~)

注1) 日本銀行発表

注2) TB11~TB17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 公式特値 日本経済新聞

注5) 3年回債(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