UEDA YAGI MONTHLY DATA ＜平成 29年（2017年） 10月＞

— 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 11 月 1 日
利 率: %
金額単位:億円

*連報ベース

平成29年10月		無担ＯＮ* 加重平均	無担ＯＮ* 最低最高	資金過不足 銀行券	資金過不足 財政等	資金過不足 過不足	オペエンド 貸出	オペエンド CP・国債 手形・共通担保資金供給オペ	オペエンド 計(△)	オペスタート 貸出	オペスタート CP・国債 手形・共通担保資金供給オペ	オペスタート CP・国債 国庫短期証券・企業金融支援	オペスタート 計	日銀当預 増減	日銀当預 日銀当預 残高	日銀当預 準備預金 残高	日銀当預 積終了先	注1) TB 3ヵ月	注2) ユーロ円 3ヵ月	注3) 金利先物 3ヵ月	注4) 新発10年国債	注5) 東証株価平均	東証一部出来高	注6) 為替円相場
			△ 0.078					国債補完供給 ＋ 3,900																112.54
								CP等買入 △ 400																
2	月	△ 0.047	0.001	＋ 600	△ 13,100	△ 12,500		共通担保(全店) △ 4,300	△ 800		共通担保(全店) ＋ 2,300	国債補完供給 △ 100	＋ 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	113.06
			△ 0.070									国債補完供給 △ 100												112.66
								国債補完供給 ＋ 100				国庫短期証券買入 ＋ 7,500												
3	火	△ 0.043	0.001	＋ 400	△ 7,500	△ 7,100		CP等買入 △ 100	＋ 0			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
			△ 0.065					国債補完供給 ＋ 100																112.42
4	水	△ 0.035	0.001	＋ 200	△ 34,000	△ 33,800		CP等買入 △ 200	△ 100			国債補完供給 △ 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
			△ 0.065					国債補完供給 ＋100				国債補完供給 △ 100												112.62
5	木	△ 0.032	0.001	△ 1,000	△ 19,800	△ 20,800		CP等買入 △ 300	△ 200			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	112.92
			△ 0.070					国債補完供給 ＋ 100				国債補完供給 △ 300												112.76
6	金	△ 0.028	0.001	△ 600	△ 2,500	△ 3,100		CP等買入 △ 200	△ 100			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	113.06
			△ 0.070					国債補完供給 ＋ 300																112.50
								CP等買入 △ 500																
10	火	△ 0.029	0.001	＋ 800	△ 25,300	△ 24,500		共通担保(全店) △ 2,400	△ 2,600		共通担保(全店) ＋ 2,000	国債補完供給 △ 300	＋ 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
			△ 0.050									国債補完供給 △ 800												112.23
												ETF買入 ＋ 800												
												CP等買入 ＋ 3,000												
								国債補完供給 ＋ 300				国庫短期証券買入 ＋ 10,000												
11	水	△ 0.024	0.001	＋ 1,100	＋ 1,600	＋ 2,700		CP等買入 △ 300	＋ 0			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
			△ 0.050					国債補完供給 ＋ 800																112.21
12	木	△ 0.021	0.001	△ 700	＋ 3,300	＋ 2,600		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	112.52
			△ 0.060									国債補完供給 △ 700												111.86
13	金	△ 0.021	0.001	△ 200	＋ 63,900	＋ 63,700		CP等買入 △ 600	△ 600			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	112.30
			△ 0.065					国債補完供給 ＋ 700				国債補完供給 △ 700												111.66
								CP等買入 △ 300				ETF買入 ＋ 600												
16	月	△ 0.043	0.001	＋ 600	△ 17,900	△ 17,300		共通担保(全店) △ 2,300	△ 1,900		共通担保(全店) ＋ 1,400	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
			△ 0.065									国債補完供給 △ 100												112.04
												ETF買入 ＋ 100												
								国債補完供給 ＋ 700				CP等買入 ＋ 3,000												
17	火	△ 0.043	0.050	＋ 200	△ 5,700	△ 5,500		CP等買入 △ 100	＋ 600			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
			△ 0.070					国債補完供給 ＋ 100				国債補完供給 △ 400												112.14
18	水	△ 0.041	0.001	△ 200	＋ 2,700	＋ 2,500		CP等買入 △ 100	＋ 0		共通担保(全店) ＋ 100	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
			△ 0.065					国債補完供給 ＋ 400																112.63
								CP等買入 △ 100																
19	木	△ 0.042	0.050	△ 1,000	△ 8,400	△ 9,400		共通担保(全店) △ 100	＋ 200			国債補完供給 △ 400	△ 400	△ 9,600	＋ 3,708,400	＋ 3,271,300	＋ 3,252,900	▲ 0.190	0.0630	0.065	0.060	21448.52	15.20	113.14
			△ 0.070					国債補完供給 ＋ 400				国債補完供給 △ 1,500												112.53
								被災地金融機関支援 △ 200				被災地金融機関支援 ＋ 100												
20	金	△ 0.041	0.001	△ 1,100	△ 8,500	△ 9,600		CP等買入 △ 400	△ 200			国債買入 ＋ 4,100	＋ 2,700	△ 7,100	＋ 3,701,300	＋ 3,266,400	＋ 3,263,400	▲ 0.206	0.0630	0.065	0.070	21457.64	15.22	113.35
			△ 0.075					国債補完供給 ＋ 1,500																113.62
								社債等買入 △ 100																
								CP等買入 △ 100																
23	月	△ 0.042	0.001	△ 100	△ 20,300	△ 20,400		共通担保(全店) △ 2,000	△ 700		共通担保(全店) ＋ 1,600	国債補完供給 △ 100	＋ 1,500	△ 19,600	＋ 3,681,700	＋ 3,252,800	＋ 3,250,100	▲ 0.208	0.0630	0.065	0.065	21696.65	15.82	114.10
			△ 0.075					国債補完供給 ＋ 100				国庫短期証券買入 ＋ 5,000												113.25
24	火	△ 0.041	0.001	△ 900	△ 2,600	△ 3,500		CP等買入 △ 200	△ 100			国債買入 ＋ 10,000	＋ 15,000	＋ 11,400	＋ 3,693,100	＋ 3,262,800	＋ 3,260,800	▲ 0.207	0.0630	0.060	0.065	21805.17	15.71	113.71
			△ 0.065					社債等買入 △ 200				国債補完供給 △ 400												113.75
25	水	△ 0.041	0.001	△ 800	＋ 8,800	＋ 8,000		CP等買入 △ 200	△ 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	113.98
			△ 0.065					国債補完供給 ＋ 400																113.35
								社債等買入 △ 100																
26	木	△ 0.041	0.001	△ 1,700	△ 3,600	△ 5,300		CP等買入 △ 300	＋ 0					△ 5,300	＋ 3,696,000	＋ 3,263,600	＋ 3,262,800	▲ 0.195	0.0630	0.065	0.065	21739.78	15.90	113.80
			△ 0.065																					113.99
27	金	△ 0.039	0.001	△ 2,000	＋ 4,600	＋ 2,600		CP等買入 △ 200	△ 200			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	114.31
			△ 0.065					社債等買入 △ 100																113.53
								CP等買入 △ 500																
30	月	△ 0.040	0.001	＋ 0	△ 12,500	△ 12,500		共通担保(全店) △ 1,400	△ 2,000		共通担保(全店) ＋ 1,300	国債補完供給 △ 200	＋ 1,100	△ 13,400	＋ 3,694,100	＋ 3,267,900	＋ 3,267,600	▲ 0.200	0.0630	0.070	0.065	22011.67	23.71	113.83
			△ 0.078									国債補完供給 △ 600												112.98
								国債補完供給 ＋ 200				CP等買入 ＋ 3,000												
								社債等買入 △ 100				国庫短期証券買入 ＋ 2,500												
31	火	△ 0.046	0.001	△ 800	△ 1,000	△ 1,800		CP等買入 △ 700	△ 600			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	113.29
月中平均		△ 0.0371	—	△ 7,062	△ 98,238	△ 105,300	—	国債買入 ＋ 79,999	—	月中実績 ＋ 0	月中実績 △ 3,745	月中実績 ＋ 8,874	月中実績 ＋ 5,129	—	＋ 12,377	—	—	▲ 0.186	0.062	0.066	0.061	21267.49	16.41	112.93
月中平均	*	△ 0.0364	—	月末残高 1,015,007	—	—	—	国庫短期証券買入 ＋ 32,549	—	月末残高 ＋ 0	月末残高 ＋ 3,281	月末残高 ＋ 456,483	月末残高 ＋ 459,764	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

*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 { 0.95 %(H28.8.10～) / 1.00 %(H29.7.11～) }

注1) 日本銀行発表
注2) TB711～TB717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) 348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