

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<平成 30年 (2018年) 7月>

平成 30年 8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30年7月 | *連動ベース    |       |         | 資金過不足   |           |           | オペエント |   |         | オペスタート           |  |                        | 注1)      |             |             |             | 注2)     |            | 注3)         |             | 注4)             |                | 注5)             |           | 注6) |
|---------|-----------|-------|---------|---------|-----------|-----------|-------|---|---------|------------------|--|------------------------|----------|-------------|-------------|-------------|---------|------------|-------------|-------------|-----------------|----------------|-----------------|-----------|-----|
|         | 加重平均      | 最低最高  | N*      | 銀行券     | 財政等       | 過不足戻      | 貸出    | CP・国債<br>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<br>国庫短期証券・企業金融支援 | 計        | 日銀当預<br>増減  | 日銀当預<br>残高  | 準備預金<br>残高  | 継続了先    | T B<br>3ヵ月 | ユーロ円<br>3ヵ月 | 金利先物<br>3ヵ月 | 新発<br>10年<br>国債 | 東証<br>平均<br>株価 | 東証<br>一部<br>出来高 | 為替<br>円相場 |     |
| 2月      | △ 0.074   | 0.001 | △ 0.086 | + 400   | △ 27,800  | △ 27,400  |       | 国債補完供給<br>共通担保(全店) △ 2,400                                      | △ 1,000 | 共通担保(全店) + 2,400 | 国債補完供給<br>ETF買入 + 100<br>国債買入 + 9,700  | + 10,800               | △ 17,600 | + 3,918,900 | + 3,416,600 | + 3,416,400 | ▲ 0.135 | 0.0780     | 0.080       | 0.020       | 21811.93        | 13.72          | 111.07          |           |     |
| 3火      | △ 0.073   | 0.001 | △ 0.086 | △ 200   | △ 6,000   | △ 6,200   |       | 国債補完供給 + 1,400  | + 1,400 |                  | 国債補完供給<br>国庫短期証券買入 + 5,000<br>国債買入 + 3,400                                   | + 8,200                | + 3,400  | + 3,922,300 | + 3,422,100 | + 3,422,000 | ▲ 0.135 | 0.0780     | 0.085       | 0.035       | 21785.54        | 14.84          | 111.14          |           |     |
| 4水      | △ 0.073   | 0.001 | △ 0.086 | + 400   | △ 51,400  | △ 51,000  |       | 国債補完供給 + 200  | + 200   |                  | 国債補完供給<br>ETF買入 + 100  | △ 100                  | △ 50,900 | + 3,871,400 | + 3,378,600 | + 3,378,400 | ▲ 0.140 | 0.0780     | 0.085       | 0.030       | 21717.04        | 13.11          | 110.58          |           |     |
| 5木      | △ 0.072   | 0.001 | △ 0.086 | △ 400   | △ 1,800   | △ 2,200   |       | 国債補完供給 + 200<br>CP等買入 △ 300                                     | △ 100   |                  | 国債補完供給<br>国債買入 + 9,900   | + 8,900                | + 6,600  | + 3,878,000 | + 3,382,700 | + 3,382,500 | ▲ 0.140 | 0.0780     | 0.080       | 0.030       | 21546.99        | 13.96          | 110.70          |           |     |
| 6金      | △ 0.069   | 0.001 | △ 0.086 | △ 100   | △ 7,100   | △ 7,200   |       | 国債補完供給 + 1,000<br>CP等買入 △ 100                                   | + 900   |                  | 国債補完供給<br>ETF買入 + 1,100  | △ 100                  | △ 6,400  | + 3,871,600 | + 3,387,000 | + 3,386,800 | ▲ 0.141 | 0.0780     | 0.085       | 0.025       | 21788.14        | 13.93          | 110.79          |           |     |
| 9月      | △ 0.071   | 0.001 | △ 0.086 | + 1,100 | + 2,300   | + 3,400   |       | 国債補完供給 + 1,200<br>共通担保(全店) △ 1,400<br>CP等買入 △ 200               | △ 400   | 共通担保(全店) + 1,300 | 国債補完供給<br>国債買入 + 8,600   | + 9,700                | + 12,700 | + 3,884,300 | + 3,421,900 | + 3,421,700 | ▲ 0.144 | 0.0780     | 0.085       | 0.025       | 22052.18        | 12.20          | 110.53          |           |     |
| 10火     | △ 0.071   | 0.001 | △ 0.086 | + 100   | + 1,000   | + 1,100   |       | 国債補完供給 + 200<br>CP等買入 △ 100                                     | + 100   |                  | CP等買入 + 2,000  | + 2,000                | + 3,200  | + 3,887,500 | + 3,434,500 | + 3,434,300 | ▲ 0.144 | 0.0910     | 0.090       | 0.035       | 22196.89        | 15.22          | 111.20          |           |     |
| 11水     | △ 0.068   | 0.001 | △ 0.086 | + 400   | △ 30,400  | △ 30,000  |       | CP等買入 △ 200   | △ 200   |                  | 国債補完供給<br>ETF買入 + 500<br>国庫短期証券買入 + 7,500                                    | + 7,800                | △ 22,400 | + 3,865,100 | + 3,417,200 | + 3,417,100 | ▲ 0.144 | 0.0910     | 0.090       | 0.035       | 21932.21        | 13.66          | 111.14          |           |     |
| 12木     | △ 0.064   | 0.001 | △ 0.086 | △ 1,100 | △ 21,800  | △ 22,900  |       | 国債補完供給 + 200<br>CP等買入 △ 200                                     | + 0     |                  | 国債補完供給<br>国債買入 + 9,700<br>ETF買入 + 800  | + 10,000               | △ 12,900 | + 3,852,200 | + 3,429,100 | + 3,429,000 | ▲ 0.147 | 0.0910     | 0.085       | 0.035       | 22187.96        | 23.08          | 112.42          |           |     |
| 13金     | △ 0.065   | 0.001 | △ 0.085 | △ 500   | + 700     | + 200     |       | 国債補完供給 + 500<br>CP等買入 △ 100                                     | + 400   |                  | 国債補完供給<br>ETF買入 + 600  | + 300                  | + 900    | + 3,853,100 | + 3,391,700 | + 3,391,700 | ▲ 0.146 | 0.0910     | 0.085       | 0.035       | 22597.35        | 12.78          | 112.80          |           |     |
| 17火     | △ 0.072   | 0.001 | △ 0.086 | + 700   | + 7,700   | + 8,400   |       | 共通担保(全店) △ 2,400<br>国債補完供給 + 300<br>CP等買入 △ 700<br>社債等買入 △ 100  | △ 2,900 | 共通担保(全店) + 2,900 | 国債補完供給<br>国債買入 + 6,900<br>ETF買入 + 600  | + 9,400                | + 14,900 | + 3,868,000 | + 3,394,000 | + 3,282,500 | ▲ 0.150 | 0.0910     | 0.090       | 0.035       | 22697.36        | 14.03          | 112.57          |           |     |
| 18水     | △ 0.072   | 0.001 | △ 0.120 | + 1,100 | + 2,900   | + 4,000   |       | 国債補完供給 + 1,000<br>CP等買入 △ 100                                   | + 900   |                  | 国債補完供給<br>国庫短期証券買入 + 5,000<br>国債買入 + 5,800<br>ETF買入 + 1,000<br>CP等買入 + 2,000 | + 13,500               | + 18,400 | + 3,886,400 | + 3,404,700 | + 3,364,300 | ▲ 0.150 | 0.0910     | 0.090       | 0.040       | 22794.19        | 11.46          | 113.14          |           |     |
| 19木     | △ 0.072   | 0.001 | △ 0.086 | △ 500   | + 0       | △ 500     |       | 国債補完供給 + 300<br>CP等買入 △ 200<br>社債等買入 △ 100                      | + 0     |                  | 国債補完供給<br>ETF買入 + 400  | △ 400                  | △ 900    | + 3,885,500 | + 3,401,700 | + 3,378,300 | ▲ 0.152 | 0.0910     | 0.090       | 0.035       | 22764.68        | 12.06          | 113.03          |           |     |
| 20金     | △ 0.072   | 0.001 | △ 0.086 | + 0     | △ 13,600  | △ 13,600  |       | 国債補完供給 + 400<br>被災地金融機関支援 △ 1,100<br>CP等買入 △ 300<br>社債等買入 △ 100 | △ 1,100 |                  | 国債補完供給<br>国債買入 + 6,800<br>被災地金融機関支援 + 1,100<br>ETF買入 + 100                   | + 7,700                | △ 7,000  | + 3,878,500 | + 3,391,500 | + 3,389,200 | ▲ 0.153 | 0.0910     | 0.090       | 0.030       | 22697.88        | 12.62          | 112.62          |           |     |
| 23月     | △ 0.068   | 0.001 | △ 0.086 | + 500   | △ 1,800   | △ 1,300   |       | 国債補完供給 + 300<br>共通担保(全店) △ 1,300<br>CP等買入 △ 300<br>社債等買入 △ 100  | △ 1,400 | 共通担保(全店) + 1,300 | 国債補完供給<br>ETF買入 + 100  | + 900                  | △ 1,800  | + 3,876,700 | + 3,388,300 | + 3,386,300 | ▲ 0.148 | 0.0910     | 0.095       | 0.080       | 22396.99        | 13.99          | 111.50          |           |     |
| 24火     | △ 0.070   | 0.001 | △ 0.086 | △ 600   | △ 5,200   | △ 5,800   |       | 国債補完供給 + 500<br>CP等買入 △ 100<br>社債等買入 △ 100                      | + 300   |                  | 国債補完供給<br>国庫短期証券買入 + 10,000<br>国債買入 + 6,000                                  | + 15,300               | + 9,800  | + 3,886,500 | + 3,398,100 | + 3,396,300 | ▲ 0.151 | 0.0910     | 0.085       | 0.080       | 22510.48        | 12.46          | 111.51          |           |     |
| 25水     | △ 0.069   | 0.001 | △ 0.086 | + 100   | + 4,600   | + 4,700   |       | CP等買入 △ 100<br>社債等買入 △ 200<br>国債補完供給 + 700                      | + 400   |                  | 国債補完供給<br>社債等買入 + 1,000  | + 500                  | + 5,600  | + 3,892,100 | + 3,403,400 | + 3,401,400 | ▲ 0.159 | 0.0910     | 0.085       | 0.065       | 22614.25        | 11.38          | 111.38          |           |     |
| 26木     | △ 0.070   | 0.001 | △ 0.086 | △ 1,300 | + 100     | △ 1,200   |       | 国債補完供給 + 500<br>CP等買入 △ 500<br>社債等買入 △ 100                      | △ 100   |                  | 国債補完供給<br>ETF買入 + 700<br>国債買入 + 6,900  | + 6,700                | + 5,400  | + 3,897,500 | + 3,404,300 | + 3,403,300 | ▲ 0.157 | 0.0910     | 0.095       | 0.085       | 22586.87        | 23.95          | 110.96          |           |     |
| 27金     | △ 0.071   | 0.001 | △ 0.086 | △ 800   | + 800     | + 0       |       | 国債補完供給 + 900<br>CP等買入 △ 200                                     | + 700   |                  | 国債補完供給<br>ETF買入 + 300  | △ 300                  | + 400    | + 3,897,900 | + 3,411,200 | + 3,410,400 | ▲ 0.158 | 0.0910     | 0.100       | 0.095       | 22712.75        | 13.81          | 111.24          |           |     |
| 30月     | △ 0.068   | 0.001 | △ 0.086 | + 100   | + 3,700   | + 3,800   |       | 国債補完供給 + 300<br>共通担保(全店) △ 2,900<br>CP等買入 △ 200                 | △ 2,800 | 共通担保(全店) + 2,600 | 国債補完供給<br>国債買入 + 10,600  | + 12,600               | + 13,600 | + 3,911,500 | + 3,423,100 | + 3,422,200 | ▲ 0.189 | 0.0910     | 0.100       | 0.100       | 22544.84        | 14.50          | 111.16          |           |     |
| 31火     | △ 0.065   | 0.001 | △ 0.086 | △ 100   | + 19,800  | + 19,700  |       | 国債補完供給 + 600<br>CP等買入 △ 1,400                                   | △ 800   |                  | 国債補完供給<br>国庫短期証券買入 + 2,500<br>国債買入 + 16,000<br>CP等買入 + 2,000                 | + 6,700                | + 25,600 | + 3,937,100 | + 3,444,100 | + 3,443,200 | ▲ 0.192 | 0.0910     | 0.090       | 0.046       | 22553.72        | 19.72          | 111.46          |           |     |
| 月中平均    | △ 0.070   | —     | —       | △ 741   | △ 123,993 | △ 124,734 | —     | 国債買入 + 100,237  | —       | 月中実績<br>+ 25     | —  | —                      | —        | —           | —           | —           | ▲ 0.151 | 0.087      | 0.089       | 0.047       | 22309.06        | 14.59          | 111.38          |           |     |
| 月末平均    | * △ 0.068 | —     | —       | —       | —         | —         | —     | 国庫短期証券買入 + 30,031   | —       | 月末実績<br>+ 3,817  | —  | —                      | —        | —           | —           | —           | —       | —          | —           | —           | —               | —              | —               | —         |     |

\*暦日ベース 基準貸付金利 ( 0.75 % (H19. 2.21~ ) 短期 フ ラ イ ム 1.475 % (H21.1.13~ ) ) ( 0.50 % (H20. 10.31~ ) 長 期 フ ラ イ ム 0.95 % (H28.8.10~ ) ) ( 0.30 % (H20. 12.19~ ) ) 1.00 % (H29.7.11~ ) )

注1) 日本銀行発表 注2) TB766~TB773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 公式計算値 日本経済新聞 注5) 351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