

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 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 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	継続了先	T B 3ヵ月	ユーロ円 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	為替 円相場	
2月	△ 0.074	0.001	△ 0.086	+ 400	△ 27,800	△ 27,400		国債補完供給 共通担保(全店) △ 2,400	△ 1,000	共通担保(全店) + 2,400	国債補完供給 ETF買入 + 100 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 国庫短期証券買入 + 5,000 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 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 CP等買入 △ 300	△ 100		国債補完供給 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 CP等買入 △ 100	+ 900		国債補完供給 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 共通担保(全店) △ 1,400 CP等買入 △ 200	△ 400	共通担保(全店) + 1,300	国債補完供給 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 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 ETF買入 + 500 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 CP等買入 △ 200	+ 0		国債補完供給 国債買入 + 9,700 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 CP等買入 △ 100	+ 400		国債補完供給 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 国債補完供給 + 300 CP等買入 △ 700 社債等買入 △ 100	△ 2,900	共通担保(全店) + 2,900	国債補完供給 国債買入 + 6,900 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 CP等買入 △ 100	+ 900		国債補完供給 国庫短期証券買入 + 5,000 国債買入 + 5,800 ETF買入 + 1,000 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 CP等買入 △ 200 社債等買入 △ 100	+ 0		国債補完供給 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 被災地金融機関支援 △ 1,100 CP等買入 △ 300 社債等買入 △ 100	△ 1,100		国債補完供給 国債買入 + 6,800 被災地金融機関支援 + 1,100 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 共通担保(全店) △ 1,300 CP等買入 △ 300 社債等買入 △ 100	△ 1,400	共通担保(全店) + 1,300	国債補完供給 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 CP等買入 △ 100 社債等買入 △ 100	+ 300		国債補完供給 国庫短期証券買入 + 10,000 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 社債等買入 △ 200 国債補完供給 + 700	+ 400		国債補完供給 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 CP等買入 △ 500 社債等買入 △ 100	△ 100		国債補完供給 ETF買入 + 700 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 CP等買入 △ 200	+ 700		国債補完供給 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 共通担保(全店) △ 2,900 CP等買入 △ 200	△ 2,800	共通担保(全店) + 2,600	国債補完供給 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 CP等買入 △ 1,400	△ 800		国債補完供給 国庫短期証券買入 + 2,500 国債買入 + 16,000 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 + 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 + 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