

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<2020年5月>

2020年6月1日

利率: %

金額単位: 億円

—資金需給動向とON/レートの推移・主要諸指標 上田八木短資株式会社—

日	種	無担保コールON 注1)		資金過不足 注2)			オペエンド 注2)			オバスタート 注2)			日銀当座預金・準備預金 注2)				新発TDB 3ヵ月物 注3)	ユーロ円		日経 平均 株価	東証 一部 売買高(億株)	為 替 円相場 注7)						
		加重 平均	最低 最高	銀行券要因	財政等要因	資金過不足	補充 貸付	計	補充 貸付	共通担保資金供給・手形	国債・国庫短期証券・CP・社債・ETF・J-REIT 国債現先、国債補充供給、貸出支援基金、等	計	日銀当座預金 増減	日銀当座預金 残高	日銀準備預金 残高	うち 積み終了先		TIBOR 3ヵ月物 注4)	金利先物 3ヵ月物 注5)				新発 10年 国債 注6)					
1	金	△ 0.044	△ 0.080	△ 1,300	△ 30,300	△ 31,600			国債補充供給 CP等買入	+ 2,000 △ 100	+ 1,900			国債補充供給	△ 1,700	△ 1,700	△ 31,400	4,090,600	3,526,100	3,525,900	▲ 0.150	▲ 0.0390	▲ 0.020	▲ 0.030	19619.35	13.64	107.40	
7	木	△ 0.035	△ 0.087	+ 2,800	△ 44,600	△ 41,800			国債補充供給 CP等買入	+ 1,700 △ 200	+ 1,500			国債補充供給 ETF買入	△ 3,100 + 1,300	△ 1,800	△ 42,100	4,048,500	3,501,700	3,501,500	▲ 0.145	▲ 0.0390	0.000	▲ 0.005	19674.77	13.51	106.40	
8	金	△ 0.027	△ 0.087	+ 2,000	+ 1,400	+ 3,400			国債補充供給	+ 3,100	+ 3,100			国債買入 ETF買入 国債補充供給	+ 8,100 + 800 △ 200	+ 8,700	+ 15,200	4,063,700	3,514,000	3,513,900	▲ 0.160	▲ 0.0390	▲ 0.015	▲ 0.005	20179.09	13.72	106.45	
11	月	△ 0.019	△ 0.070	+ 1,700	△ 37,400	△ 35,700			共通担保(全店) CP等買入 国債補充供給	△ 13,400 △ 200 + 200	△ 13,400			共通担保(全店)	+ 8,500	+ 7,700	△ 41,400	4,022,300	3,483,700	3,483,500	▲ 0.144	▲ 0.0390	▲ 0.015	0.005	20390.66	13.13	107.24	
12	火	△ 0.022	△ 0.060	+ 1,700	+ 13,400	+ 15,100			CP等買入 国債補充供給	△ 500 + 800	+ 300			国債買入 ETF買入 国債補充供給	+ 7,300 + 800 △ 200	+ 7,900	+ 23,300	4,045,600	3,499,000	3,498,700	▲ 0.144	▲ 0.0490	▲ 0.025	▲ 0.010	20366.48	12.41	107.68	
13	水	△ 0.026	△ 0.087	+ 800	△ 26,000	△ 25,200			CP等買入 国債補充供給	△ 200 + 200	+ 0			米ドル資金供給用担保国債供給 国債補充供給 国庫短期証券買入	△ 1,000 △ 100 + 15,000	+ 13,900	△ 11,300	4,034,300	3,494,600	3,494,400	▲ 0.144	▲ 0.0490	▲ 0.025	▲ 0.005	20267.05	13.19	107.27	
14	木	△ 0.020	△ 0.060	+ 400	+ 3,500	+ 3,900			CP等買入 国債補充供給	△ 200 + 100	△ 100			国債補充供給 ETF買入 社債等買入 国債買入	△ 200 + 1,200 + 3,000 + 8,400	+ 12,400	+ 16,200	4,050,500	3,513,800	3,513,600	▲ 0.140	▲ 0.0420	▲ 0.015	▲ 0.010	19914.78	13.29	107.05	
15	金	△ 0.040	△ 0.080	+ 1,000	+ 38,900	+ 39,900			CP等買入 被災地金融機関支援 国債補充供給 米ドル資金供給用担保国債供給	△ 700 △ 300 + 200 + 5,600	+ 4,800			ETF買入 被災地金融機関支援 国債補充供給 新型コロナ対応金融支援特別	+ 300 + 400 △ 700 + 86,800	+ 86,800	+ 131,500	4,182,000	3,629,700	3,629,700	▲ 0.130	▲ 0.0420	▲ 0.020	▲ 0.007	20037.47	12.93	107.43	
18	月	△ 0.058	△ 0.085	+ 1,100	△ 24,700	△ 23,600			CP等買入 国債補充供給	△ 400 + 700	+ 300			国債補充供給 ETF買入 CP等買入 国債買入	△ 1,000 + 2,500 + 8,000 + 4,600	+ 14,100	△ 9,200	4,172,800	3,598,300	3,568,000	▲ 0.130	▲ 0.0420	▲ 0.015	▲ 0.015	20133.73	12.10	107.28	
19	火	△ 0.061	△ 0.087	+ 800	△ 35,000	△ 34,200			CP等買入 国債補充供給	△ 300 + 1,000	+ 700			ETF買入 国債補充供給	+ 100 △ 300	△ 200	△ 33,700	4,139,100	3,573,700	3,561,900	▲ 0.132	▲ 0.0420	▲ 0.015	0.000	20433.45	15.89	107.53	
20	水	△ 0.061	△ 0.087	+ 200	+ 33,400	+ 33,600			CP等買入 国債補充供給	△ 400 + 300	△ 100			米ドル資金供給用担保国債供給 国債補充供給 ETF買入 国債買入	△ 100 △ 100 + 900 + 7,900	+ 8,600	+ 42,100	4,181,200	3,578,300	3,572,100	▲ 0.132	▲ 0.0420	▲ 0.020	0.000	20595.15	12.14	107.99	
21	木	△ 0.062	△ 0.087	△ 400	△ 13,700	△ 14,100			CP等買入 社債等買入 国債補充供給	△ 200 △ 100 + 100	△ 200					+ 0	△ 14,300	4,166,900	3,590,300	3,587,200	▲ 0.134	▲ 0.0420	▲ 0.030	▲ 0.005	20552.31	11.48	107.85	
22	金	△ 0.059	△ 0.087	△ 200	+ 32,300	+ 32,100			CP等買入	△ 200	△ 200			国債補充供給 ETF買入 国債買入 国庫短期証券買入	△ 100 + 1,700 + 7,800 + 15,000	+ 24,400	+ 56,300	4,223,200	3,639,900	3,637,900	▲ 0.134	▲ 0.0420	▲ 0.030	▲ 0.010	20388.16	12.29	107.76	
25	月	△ 0.059	△ 0.086	△ 100	△ 37,000	△ 37,100			共通担保(全店) CP等買入 社債等買入 国債補充供給	△ 8,500 △ 600 △ 100 + 100	△ 9,100			共通担保(全店)	+ 4,000	+ 3,700	△ 42,500	4,180,700	3,603,800	3,602,400	▲ 0.118	▲ 0.0420	▲ 0.025	0.000	20741.65	10.02	107.78	
26	火	△ 0.060	△ 0.087	△ 800	+ 14,500	+ 13,700			CP等買入 社債等買入 国債補充供給	△ 800 △ 300 + 300	△ 800			国債買入 社債等買入 ETF買入 国債補充供給	+ 11,100 + 2,000 + 300 △ 200	+ 13,200	+ 26,100	4,206,800	3,628,600	3,627,000	▲ 0.117	▲ 0.0420	▲ 0.025	0.000	21271.17	14.72	107.92	
27	水	△ 0.059	△ 0.087	△ 600	△ 1,500	△ 2,100			CP等買入 国債補充供給	△ 200 + 200	+ 0			国庫短期証券買入 新型コロナ対応金融支援特別	+ 20,000 + 17,300	+ 37,300	+ 35,200	4,242,000	3,648,500	3,647,200	▲ 0.117	▲ 0.0420	▲ 0.020	▲ 0.003	21419.23	17.63	107.62	
28	木	△ 0.057	△ 0.087	△ 1,500	+ 13,000	+ 11,500			CP等買入 社債等買入	△ 600 △ 100	△ 700			ETF買入 国債補充供給 米ドル資金供給用担保国債供給	+ 600 △ 300 △ 1,000	△ 700	+ 10,100	4,252,100	3,660,100	3,659,400	▲ 0.119	▲ 0.0420	▲ 0.020	▲ 0.005	21916.31	20.87	107.91	
29	金	△ 0.073	△ 0.087	△ 900	+ 14,100	+ 13,200			CP等買入 国債補充供給	△ 2,100 + 300	△ 1,800			CP等買入 国債補充供給	+ 8,000 △ 100	+ 7,900	+ 19,300	4,271,400	3,681,900	3,681,600	▲ 0.117	▲ 0.0420	▲ 0.015	0.000	21877.89	23.83	107.72	
月中平均 (営業日ベース)		△ 0.047	—	+ 6,571	△ 85,634	△ 79,063	—	—	国債買入 + 55,236	—	—	—	—	月中実績 △ 9,410	—	—	—	—	—	—	▲ 0.134	▲ 0.042	▲ 0.019	▲ 0.006	20543.26	14.27	107.30	
月中平均 (暦日ベース)		△ 0.046	—	月末残高 1,113,536	—	—	—	—	国庫短期証券買入 + 50,046	—	—	—	—	月末残高 + 3,961	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

基準貸付金利 { 0.75 % (2007.2.21~)
0.50 % (2008.10.31~)
0.30 % (2008.12.19~)

短期プライム 1.475 % (2009.1.13~)
長期プライム 1.05 % (2020.5.8~)

注1) 連報ベース、日本銀行金融市場局
注2) 連報ベース、日本銀行金融市場局
注3) TDB903、904、906、907、909回債、日本相互証券
注4) 東京銀行間取引金利(360日ベース)、全銀協TIBOR運営機関

注5) 中心限月の清算値(金利換算値)、東京金融取引所
注6) 単利ベース、日本証券業協会
注7) 上段は高値、下段は安値、日本銀行金融市場局