

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<2020年6月>

2020年7月1日

—資金需給動向とONレートの推移・主要諸指標 上田八木証券株式会社—

利率: %

日	月	無担保コールON 注1)		資金過不足 注2)			オペエンド 注2)		オベスタート 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		新発 10年 国債 注6)	日経 平均 株価	東証 一部 最高(優株)	為替 円相場 注7)		
		加重 平均	最低	銀行券要因	財政等要因	資金過不足	補完 貸付	計	補完 貸付	共通担保資金供給・手形	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)						
1	月	△ 0.058	△ 0.087	△ 200	△ 74,900	△ 75,100			国債補完供給 + 100	+ 100														107.49
2	火	△ 0.059	△ 0.085	△ 900	△ 24,800	△ 25,700			CP等買入 △ 100 社債等買入 △ 100 国債補完供給 + 700	+ 500														107.52
3	水	△ 0.068	△ 0.087	+ 100	△ 44,700	△ 44,600			CP等買入 △ 300 社債等買入 △ 100 国債補完供給 + 400 成長基盤強化支援 △ 4,500	△ 4,500														108.42
4	木	△ 0.064	△ 0.080	△ 500	+ 900	+ 400			社債等買入 △ 100 国債補完供給 + 200	+ 100														108.80
5	金	△ 0.057	△ 0.087	+ 100	△ 2,200	△ 2,100			CP等買入 △ 300 国債補完供給 + 500	+ 200														109.15
8	月	△ 0.055	△ 0.087	+ 300	△ 40,600	△ 40,300			CP等買入 △ 200 国債補完供給 + 300	+ 100														109.05
9	火	△ 0.048	△ 0.087	△ 300	+ 9,400	+ 9,100			CP等買入 △ 500 国債補完供給 + 400	△ 100														109.37
10	水	△ 0.038	△ 0.087	△ 100	△ 6,300	△ 6,400			CP等買入 △ 700 国債補完供給 + 500	△ 200														107.80
11	木	△ 0.031	△ 0.070	△ 1,200	+ 1,800	+ 600			CP等買入 △ 600 国債補完供給 + 600	+ 0														108.54
12	金	△ 0.023	△ 0.080	△ 900	△ 3,500	△ 4,400			CP等買入 △ 700 社債等買入 △ 700 被災地金融機関支援 △ 900 国債補完供給 + 500 米ドル資金供給用担保国債供給 + 9,500	+ 7,700														107.29
15	月	△ 0.018	△ 0.060	△ 200	+ 24,000	+ 23,800			共通担保(全店) △ 4,000 CP等買入 △ 500 国債補完供給 + 300	△ 4,200														107.24
16	火	△ 0.056	△ 0.080	△ 300	△ 28,300	△ 28,600			CP等買入 △ 200 国債補完供給 + 100	△ 100														107.17
17	水	△ 0.055	△ 0.080	△ 1,100	△ 200	△ 1,300			CP等買入 △ 300 国債補完供給 + 600	+ 300														107.63
18	木	△ 0.055	△ 0.080	△ 2,300	+ 3,300	+ 1,000			CP等買入 △ 400 国債補完供給 + 300	△ 100														107.43
19	金	△ 0.042	△ 0.080	△ 1,200	△ 17,800	△ 19,000			CP等買入 △ 700 社債等買入 △ 800 国債補完供給 + 400 米ドル資金供給用担保国債供給 + 85,800 貸出増加支援 △ 49,100	+ 35,600														106.70
22	月	△ 0.045	△ 0.080	△ 800	+ 75,000	+ 74,200			CP等買入 △ 100 国債補完供給 + 100	+ 0														107.05
23	火	△ 0.042	△ 0.080	△ 1,500	+ 600	△ 900			CP等買入 △ 500 国債補完供給 + 100	△ 400														106.79
24	水	△ 0.043	△ 0.080	△ 1,700	△ 1,400	△ 3,100			CP等買入 △ 500 国債補完供給 + 100	△ 500														106.39
25	木	△ 0.042	△ 0.080	△ 2,900	+ 8,800	+ 5,900			CP等買入 △ 700 社債等買入 △ 500 新型コロナ対応金融支援特別 △ 34,000	△ 35,200														106.64
26	金	△ 0.038	△ 0.080	△ 1,600	△ 4,800	△ 6,400			CP等買入 △ 1,200 国債補完供給 + 100 米ドル資金供給用担保国債供給 + 44,200	+ 43,100														107.02
29	月	△ 0.041	△ 0.087	△ 1,200	△ 32,000	△ 33,200			共通担保(全店) △ 2,300 CP等買入 △ 200 国債補完供給 + 100	△ 2,400														107.25
30	火	△ 0.068	△ 0.087	△ 900	+ 17,200	+ 16,300			CP等買入 △ 5,800 国債補完供給 + 100	△ 5,700														106.95
月中平均		△ 0.048		△ 19,243	△ 141,212	△ 160,455			国債買入 △ 2,061															107.55
月中平均		△ 0.046		月末残高 1,132,779					国債買入 + 76,930															107.04
月末平均									国債買入 + 120,103															107.38
月末平均									米ドル資金供給用担保国債供給 + 120,103															107.55
月末平均									米ドル資金供給用担保国債供給 + 120,103															107.79
月末平均									米ドル資金供給用担保国債供給 + 120,103															107.58

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) TDB911、912、914、917、918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(金利換算額)、東京金融取引所
注6) 東証一部、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