

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<2020年8月>

2020年9月1日

利率: 9%

金額単位: 億円

—資金需給動向とONレートの推移・主要種指標 上田八木短資株式会社—

日	月	無担保コールON 注1)		資金過不足 注2)			オペエント 注2)		オバースタート 注2)				日銀当座預金 増減	日銀当座預金・準備預金 注2)		うち 積み終了先	新発TDB 3か月物 注3)	ユーロ円		新発 10年 国債 注6)	日経 平均 株価	東証 一部 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 残高	日銀準備預金 残高			TIBOR 3か月物 注4)	金利先物 3か月物 注5)				
3	月	△ 0.020	△ 0.060	+ 600	△ 47,100	△ 46,500		CP等買入 △ 200	△ 200		国債買入 + 4,700 ETF買入 + 100	+ 4,800	△ 41,900	4,532,600	3,967,000	3,966,800	▲ 0.079	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.020	22195.38	13.22	106.44
4	火	△ 0.021	△ 0.060	+ 500	△ 58,600	△ 58,100			+ 0		国債補充供給 △ 600 ETF買入 + 100 国債買入 + 4,500	+ 4,000	△ 54,100	4,478,500	3,901,700	3,901,700	▲ 0.078	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.010	22573.66	14.03	106.19
5	水	△ 0.022	△ 0.060	+ 400	△ 26,600	△ 26,200		CP等買入 △ 200 国債補充供給 + 600 米ドル資金供給用担保国債供給 △ 1,700	△ 1,300		国庫短期証券買入 + 20,000 ETF買入 + 100 国債補充供給 △ 200	+ 19,900	△ 7,600	4,470,900	3,901,700	3,901,600	▲ 0.078	▲ 0.0650	▲ 0.050	0.005	22514.85	12.04	105.79
6	木	△ 0.022	△ 0.055	△ 700	△ 900	△ 1,600		CP等買入 △ 100	△ 100		国債買入 + 6,000 ETF買入 + 100	+ 6,100	+ 4,400	4,475,500	3,895,800	3,895,700	▲ 0.076	▲ 0.0650	▲ 0.050	0.015	22418.15	10.79	105.64
7	金	△ 0.020	△ 0.055	△ 400	+ 6,200	+ 5,800		CP等買入 △ 700	△ 700		米ドル資金供給用担保国債供給 + 2,500 ETF買入 + 600 社債等買入 + 3,000	+ 6,100	+ 11,200	4,486,700	3,895,700	3,895,700	▲ 0.063	▲ 0.0650	▲ 0.050	0.005	22329.94	11.89	105.64
11	火	△ 0.020	△ 0.055	+ 600	△ 32,500	△ 31,900		共通担保(全店) △ 3,100 CP等買入 △ 300	△ 3,400	共通担保(全店) + 2,900	国債買入 + 9,500 国債補充供給 △ 2,200	+ 10,200	△ 25,100	4,461,600	3,886,900	3,886,800	▲ 0.061	▲ 0.0650	▲ 0.035	0.025	22750.24	16.27	106.23
12	水	△ 0.019	△ 0.055	+ 500	△ 1,800	△ 1,300		国債補充供給 + 2,200 社債等買入 △ 100 CP等買入 △ 100	+ 2,000		国債補充供給 △ 800 ETF買入 + 300	△ 500	+ 200	4,461,800	3,881,100	3,881,100	▲ 0.062	▲ 0.0650	▲ 0.035	0.038	22843.96	14.91	106.82
13	木	△ 0.016	△ 0.050	△ 400	△ 6,800	△ 7,200		国債補充供給 + 800 CP等買入 △ 1,200	△ 400		国債補充供給 △ 300 国庫短期証券買入 + 30,000	+ 29,700	+ 22,100	4,483,900	3,891,100	3,891,100	▲ 0.066	▲ 0.0650	▲ 0.035	0.030	23249.61	14.11	106.87
14	金	△ 0.024	△ 0.065	+ 200	+ 77,100	+ 77,300		CP等買入 △ 200 国債補充供給 + 300 新型コロナ対応金融支援特別 △ 86,800 米ドル資金供給用担保国債供給 + 1,700	△ 85,000		国債買入 + 12,100 ETF買入 + 200 国債補充供給 △ 300 新型コロナ対応金融支援特別 + 49,400	+ 61,400	+ 53,700	4,537,600	3,933,200	3,933,200	▲ 0.082	▲ 0.0650	▲ 0.030	0.045	23289.36	10.55	107.04
17	月	△ 0.053	△ 0.080	+ 900	△ 20,400	△ 19,500		CP等買入 △ 600 国債補充供給 + 300	△ 300		ETF買入 + 800 国債補充供給 △ 400	+ 400	△ 19,400	4,518,200	3,936,300	3,851,900	▲ 0.089	▲ 0.0650	▲ 0.035	0.040	23096.75	8.19	106.65
18	火	△ 0.045	△ 0.080	+ 1,200	+ 100	+ 1,300		CP等買入 △ 100	△ 100			+ 0	+ 1,200	4,519,800	3,950,600	3,926,200	▲ 0.093	▲ 0.0650	▲ 0.045	0.035	23051.08	9.74	106.05
19	水	△ 0.040	△ 0.075	+ 0	△ 9,800	△ 9,800		CP等買入 △ 300	△ 300		国庫短期証券買入 + 25,000 ETF買入 + 900 国債補充供給 △ 200	+ 25,700	+ 15,600	4,535,400	3,958,500	3,954,600	▲ 0.097	▲ 0.0650	▲ 0.050	0.025	23110.61	9.15	105.60
20	木	△ 0.039	△ 0.075	△ 200	△ 23,400	△ 23,600		CP等買入 △ 400 国債補充供給 + 200	△ 200		国債買入 + 8,100 CP等買入 + 5,400 国債補充供給 △ 600	+ 12,900	△ 10,900	4,524,500	3,932,000	3,930,300	▲ 0.100	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.025	22880.62	9.45	106.21
21	金	△ 0.037	△ 0.075	△ 100	△ 12,700	△ 12,800		CP等買入 △ 300 被災地金融機関支援 △ 900 米ドル用担保国債供給 + 1,000 国債補充供給 + 600	+ 400		被災地金融機関支援 + 2,000 国債補充供給 △ 100	+ 1,900	△ 10,500	4,514,000	3,917,900	3,917,400	▲ 0.100	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.030	22920.30	9.10	105.78
24	月	△ 0.041	△ 0.075	+ 200	△ 17,100	△ 16,900		共通担保(全店) △ 2,900 CP等買入 △ 300 国債補充供給 + 100	△ 3,100	共通担保(全店) + 2,800	国債買入 + 8,800 ETF買入 + 300 国債補充供給 △ 200	+ 11,700	△ 8,300	4,505,700	3,936,400	3,935,900	▲ 0.090	▲ 0.0650	▲ 0.050	0.020	22985.51	7.76	105.94
25	火	△ 0.048	△ 0.080	+ 300	△ 30,600	△ 30,300		CP等買入 △ 400 社債等買入 △ 100 国債補充供給 + 200	△ 300		国債買入 + 4,500 社債等買入 + 2,000	+ 6,500	△ 24,100	4,481,600	3,898,900	3,898,500	▲ 0.093	▲ 0.0740	▲ 0.060	0.029	23296.77	12.09	106.21
26	水	△ 0.051	△ 0.080	△ 400	△ 4,000	△ 4,400		CP等買入 △ 300	△ 300			+ 0	△ 4,700	4,476,900	3,890,700	3,890,300	▲ 0.093	▲ 0.0740	▲ 0.055	0.040	23290.86	8.59	106.56
27	木	△ 0.054	△ 0.080	△ 800	+ 1,400	+ 600		貸出増加支援 △ 100 新型コロナ対応金融支援特別 △ 17,300 社債等買入 △ 200 CP等買入 △ 300	△ 17,900		新型コロナ対応金融支援特別 + 133,500 ETF買入 + 400 国債買入 + 12,200 国庫短期証券買入 + 30,000	+ 176,100	+ 158,800	4,635,700	4,029,800	4,029,500	▲ 0.093	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.040	23208.86	9.23	106.07
28	金	△ 0.054	△ 0.080	△ 300	+ 5,900	+ 5,600		CP等買入 △ 400 米ドル資金供給用担保国債供給 + 1,000	+ 600		CP等買入 + 6,000 ETF買入 + 500	+ 6,500	+ 12,700	4,648,400	4,025,200	4,024,700	▲ 0.098	▲ 0.0650	▲ 0.045	0.055	22882.65	16.66	106.94
31	月	△ 0.057	△ 0.087	+ 200	△ 5,400	△ 5,200		CP等買入 △ 2,900	△ 2,900		国債買入 + 2,100 国債補充供給 △ 200	+ 1,900	△ 6,200	4,642,200	4,020,300	4,020,200	▲ 0.127	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.045	23139.76	13.41	105.83
月中平均 (速報ベース)		△ 0.035	—	+ 2,371	△ 207,696	△ 205,325		国債買入 + 72,560	—		月中実績 △ 259	—	—	—	—	—	▲ 0.086	▲ 0.066	▲ 0.048	0.029	22901.45	11.56	106.04
月中平均 (遅日ベース)		△ 0.033	—	月末残高 1,136,614	—	—		国庫短期証券買入 + 105,043	—		月末残高 + 2,802	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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 1.00 % (2020.8.12~)

注1) 速報ベース、日本銀行金融市場局  
注2) 速報ベース、日本銀行金融市場局  
注3) TDB926、928、929、931、933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