

UEDA YAGI MONTHLY DATA

<2020年 1月>

2020年2月3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 —

利率: %

2020年 1月	*速報ベース		資金過不足			オペエント			オベスタート				注1)				注2)		注3)		注4)		注5)		注6) 為替 円相場
	加重 平均	最低 最高	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	積戻り先	T B 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	金額単位:億円			
6月	△ 0.061	0.001	+ 6,300	△ 21,000	△ 14,700		国債補充供給 + 900	+ 900			+ 0	△ 13,800	+ 3,991,700	+ 3,469,600	+ 3,469,300	▲ 0.110	0.0210	0.025	▲ 0.035	23204.86	12.19		107.77		
7火	△ 0.064	0.001	+ 5,700	+ 6,000	+ 11,700		CP等買入 △ 100	△ 100		国債補充供給 △ 200 国債買入 + 9,300	+ 9,100	+ 20,700	+ 4,012,400	+ 3,491,900	+ 3,491,600	▲ 0.100	0.0210	0.020	▲ 0.010	23575.72	11.57		108.28		
8水	△ 0.061	0.001	+ 4,300	△ 53,900	△ 49,600		国債補充供給 + 200	+ 200		ETF買入 + 100	+ 100	△ 49,300	+ 3,963,100	+ 3,455,300	+ 3,455,100	▲ 0.110	0.0210	0.020	▲ 0.015	23204.76	14.53		108.50		
9木	△ 0.052	0.001	+ 2,700	+ 3,300	+ 6,000		CP等買入 △ 200	△ 200		国債補充供給 △ 100	△ 100	+ 5,700	+ 3,968,800	+ 3,453,500	+ 3,453,200	▲ 0.125	0.0210	0.020	▲ 0.005	23739.87	11.46		109.2		
10金	△ 0.035	0.001	+ 2,600	△ 5,100	△ 2,500		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 400	△ 300		国債補充供給 △ 300	△ 300	△ 3,100	+ 3,965,700	+ 3,442,800	+ 3,442,600	▲ 0.135	0.0210	0.020	▲ 0.005	23850.57	10.91		109.60		
14火	△ 0.028	0.001	+ 3,100	+ 2,100	+ 5,200		国債補充供給 + 300 共通担保(全店) △ 6,000 CP等買入 △ 400	△ 6,100		国債補充供給 △ 200 国債買入 + 11,900	+ 17,600	+ 16,700	+ 3,982,400	+ 3,483,800	+ 3,483,700	▲ 0.122	0.0210	0.020	0.010	24025.17	12.34		109.92		
15水	△ 0.016	0.001	+ 2,500	△ 7,400	△ 4,900		国債補充供給 + 200 CP等買入 △ 300	△ 100		国債補充供給 △ 500 国債買入 + 1,500	+ 1,000	△ 4,000	+ 3,978,400	+ 3,480,700	+ 3,480,700	▲ 0.124	0.0210	0.020	0.005	23916.58	11.22		109.82		
16木	△ 0.042	0.001	+ 1,700	△ 24,600	△ 22,900		国債補充供給 + 500 CP等買入 △ 100	+ 400		国債補充供給 △ 800 国庫短期証券買入 + 10,000 ETF買入 + 600	+ 9,800	△ 12,700	+ 3,965,700	+ 3,454,300	+ 3,461,900	▲ 0.124	0.0210	0.025	0.005	23933.13	10.33		109.99		
17金	△ 0.023	0.001	+ 2,400	+ 100	+ 2,500		国債補充供給 △ 400 CP等買入 + 800	+ 400		国債補充供給 △ 1,500 国債買入 + 3,700	+ 2,200	+ 5,100	+ 3,970,800	+ 3,456,400	+ 3,441,400	▲ 0.127	0.0021	0.020	▲ 0.005	24041.26	10.79		110.16		
20月	△ 0.018	0.001	+ 1,800	△ 11,000	△ 9,200		国債補充供給 + 1,500 CP等買入 △ 200	+ 1,300		国債補充供給 △ 100 CP等買入 + 2,500 ETF買入 + 100	+ 2,500	△ 5,400	+ 3,965,400	+ 3,440,800	+ 3,432,400	▲ 0.130	0.0210	0.020	0.005	24083.51	8.21		110.09		
21火	△ 0.018	0.001	+ 1,400	△ 800	+ 600		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 100	+ 0		国債補充供給 △ 100 国債買入 + 8,200 ETF買入 + 100	+ 8,200	+ 8,800	+ 3,974,200	+ 3,449,800	+ 3,445,200	▲ 0.130	0.0210	0.020	▲ 0.010	23864.56	9.12		110.22		
22水	△ 0.018	0.001	+ 900	△ 3,900	△ 3,000		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 200	△ 100		ETF買入 + 600	+ 600	△ 2,500	+ 3,971,700	+ 3,443,100	+ 3,439,800	▲ 0.130	0.0210	0.015	▲ 0.005	24031.35	10.01		109.89		
23木	△ 0.018	0.001	△ 200	△ 3,600	△ 3,800		CP等買入 △ 100	△ 100		国庫短期証券買入 + 10,000	+ 10,000	+ 6,100	+ 3,977,800	+ 3,454,100	+ 3,450,700	▲ 0.130	0.0210	0.015	▲ 0.025	23795.44	10.49		110.10		
24金	△ 0.016	0.001	+ 300	+ 10,500	+ 10,800		CP等買入 △ 200 社債等買入 △ 200	△ 400		国債補充供給 △ 200 国債買入 + 5,600	+ 5,400	+ 15,800	+ 3,993,600	+ 3,463,500	+ 3,462,500	▲ 0.125	0.0210	0.015	▲ 0.025	23827.18	9.65		109.51		
27月	△ 0.019	0.001	+ 700	+ 15,400	+ 16,100		国債補充供給 + 200 共通担保(全店) △ 5,900 CP等買入 △ 600	△ 6,300		共通担保(全店) + 7,000	+ 7,000	+ 16,800	+ 4,010,400	+ 3,480,000	+ 3,478,800	▲ 0.120	0.0210	0.015	▲ 0.050	23343.51	11.80		109.44		
28火	△ 0.020	0.001	+ 500	+ 300	+ 800		CP等買入 △ 300	△ 300		ETF買入 + 100 国債補充供給 △ 100	+ 0	+ 500	+ 4,010,900	+ 3,482,800	+ 3,482,100	▲ 0.128	0.0210	0.010	▲ 0.040	23215.71	11.71		109.57		
29水	△ 0.025	0.001	+ 400	△ 3,300	△ 2,900		国債補充供給 + 100 CP等買入 △ 100	+ 0		国債補充供給 △ 200 国庫短期証券買入 + 7,500 社債等買入 + 1,000 ETF買入 + 600	+ 8,900	+ 6,000	+ 4,016,900	+ 3,489,500	+ 3,489,100	▲ 0.138	0.0210	0.020	▲ 0.040	23379.40	10.32		108.73		
30木	△ 0.032	0.001	+ 200	+ 5,400	+ 5,600		国債補充供給 + 200 CP等買入 △ 200	+ 0		国債補充供給 △ 300 国債買入 + 12,000 ETF買入 + 100	+ 11,800	+ 17,400	+ 4,034,300	+ 3,501,200	+ 3,500,500	▲ 0.130	0.0210	0.010	▲ 0.060	22977.75	13.67		108.83		
31金	△ 0.039	0.001	+ 500	△ 3,400	△ 2,900		国債補充供給 + 300 CP等買入 △ 1,000 社債等買入 △ 100	△ 800		国債補充供給 △ 200 CP等買入 + 2,500	+ 2,300	△ 1,400	+ 4,032,900	+ 3,510,400	+ 3,510,000	▲ 0.135	0.0210	0.010	▲ 0.065	23205.18	13.76		109.14		
月平均	△ 0.032	—	+ 37,729	△ 95,157	△ 57,428		国債買入 + 52,222	—	月中実績	月中実績 + 1,001	—	—	—	—	—	▲ 0.125	0.020	0.018	▲ 0.019	23642.92	11.27		109.35		
月平均*	△ 0.036	—	月末残高 1,089,688	—	—		国庫短期証券買入 + 27,528	—	月末残高	月末残高 + 6,998	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	

*暦日ベース

基準貸付金利

0.75 % (2007.2.21~)
0.50 % (2008.10.31~)
0.30 % (2008.12.19~)

短期ﾌﾞﾗｲﾑ {
長期ﾌﾞﾗｲﾑ {

1.475 % (2009.1.13~)
1.00 % (2017.7.11~)
0.95 % (2019.7.10~)

注1) 日本銀行発表
注2) TBS78回~884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 公式終値 日本経済新聞
注5) 356~357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