UEDA YAGI MONTHLY DATA ＜2020年7月＞

—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—

2020年8月3日
利　率：　%
金額単位：億円

		無担保コールON 注1)		資金過不足 注2)			オペエンド 注2)			オペスタート 注2)				日銀当座預金・準備預金 注2)				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	補完貸付		計	補完貸付	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、国債補完供給、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か月物 注4)	金利先物 3か月物 注5)				
1	水	△ 0.041	△ 0.080 0.001	△ 600	△ 28,000	△ 28,600		CP等買入 国債補完供給	△ 100 ＋ 2,400 ＋ 2,300			国庫短期証券買入 ETF買入 米ドル資金供給用担保国債供給	＋ 30,000 ＋ 100 △ 4,000	＋ 26,100	△ 200	4,470,000	3,850,500	3,850,400	▲ 0.090	▲ 0.0650	▲ 0.025	0.045	22121.73	11.84	107.55 108.16
2	木	△ 0.039	△ 0.080 0.001	△ 1,300	△ 31,000	△ 32,300		CP等買入	△ 200 △ 200			国債買入 ETF買入 国債補完供給	＋ 4,600 ＋ 900 △ 100	＋ 5,400	△ 27,100	4,442,900	3,831,500	3,831,400	▲ 0.080	▲ 0.0650	▲ 0.035	0.040	22145.96	13.57	107.34 107.55
3	金	△ 0.034	△ 0.080 0.001	△ 800	△ 24,500	△ 25,300		CP等買入 社債等買入 国債補完供給 米ドル資金供給用担保国債供給	△ 300 △ 100 ＋ 100 ＋ 36,300 ＋ 36,000			ETF買入	＋ 400	＋ 400	＋ 11,100	4,454,000	3,847,500	3,847,400	▲ 0.093	▲ 0.0650	▲ 0.050	0.020	22306.48	9.82	107.44 107.57
6	月	△ 0.034	△ 0.080 0.001	△ 100	△ 34,500	△ 34,600			＋ 0			国債買入 ETF買入	＋ 9,200 ＋ 1,000	＋ 10,200	△ 24,400	4,429,600	3,835,700	3,835,700	▲ 0.114	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.040	22714.44	10.25	107.55 107.77
7	火	△ 0.027	△ 0.070 0.001	＋ 500	＋ 7,500	＋ 8,000		CP等買入	△ 200 △ 200			国債買入 国債補完供給	＋ 4,200 △ 200	＋ 4,000	＋ 11,800	4,441,400	3,832,600	3,832,500	▲ 0.114	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.033	22614.69	10.93	107.25 107.63
8	水	△ 0.023	△ 0.070 0.001	＋ 200	△ 6,800	△ 6,600		CP等買入 国債補完供給	△ 100 ＋ 200 ＋ 100			国庫短期証券買入 ETF買入 国債補完供給 米ドル資金供給用担保国債供給	＋ 25,000 ＋ 1,700 △ 200 △ 3,700	＋ 22,800	＋ 16,300	4,457,700	3,828,500	3,828,400	▲ 0.114	▲ 0.0650	▲ 0.060	0.015	22438.65	11.55	107.43 107.71
9	木	△ 0.021	△ 0.060 0.001	△ 400	＋ 4,800	＋ 4,400		CP等買入 国債補完供給	△ 300 ＋ 200 △ 100			国債買入 社債等買入	＋ 8,800 ＋ 3,000	＋ 11,800	＋ 16,100	4,473,800	3,845,900	3,845,800	▲ 0.115	▲ 0.0650	▲ 0.065	0.015	22529.29	11.75	107.18 107.36
10	金	△ 0.017	△ 0.055 0.001	＋ 100	△ 31,900	△ 31,800		CP等買入 米ドル資金供給用担保国債供給	△ 400 ＋ 21,500 ＋ 21,100			ETF買入	＋ 400	＋ 400	△ 10,300	4,463,500	3,859,000	3,859,000	▲ 0.115	▲ 0.0650	▲ 0.065	0.015	22290.81	13.37	106.81 107.26
13	月	△ 0.019	△ 0.055 0.001	＋ 500	△ 17,000	△ 16,500		共通担保(全店) CP等買入 新型コロナ対応金融支援特別	△ 1,900 △ 300 △ 5,600 △ 7,800		共通担保(全店)　＋ 1,900	国債買入 国債補完供給 新型コロナ対応金融支援特別	＋ 8,800 △ 200 ＋ 23,300	＋ 33,800	＋ 9,500	4,473,000	3,895,200	3,895,200	▲ 0.084	▲ 0.0650	▲ 0.060	0.025	22784.74	12.15	106.79 107.00
14	火	△ 0.017	△ 0.055 0.001	＋ 600	△ 22,700	△ 22,100		CP等買入 国債補完供給	△ 500 ＋ 200 △ 300					＋ 0	△ 22,400	4,450,600	3,868,900	3,868,800	▲ 0.087	▲ 0.0650	▲ 0.050	0.020	22587.01	10.96	107.12 107.36
15	水	△ 0.014	△ 0.050 0.001	＋ 100	△ 16,100	△ 16,000		CP等買入 社債等買入	△ 400 △ 100 △ 500			国庫短期証券買入 米ドル資金供給用担保国債供給	＋ 30,000 △ 4,400	＋ 25,600	＋ 9,100	4,459,700	3,848,700	3,848,700	▲ 0.088	▲ 0.0650	▲ 0.050	0.020	22945.50	12.45	106.95 107.31
16	木	△ 0.050	△ 0.075 0.001	△ 1,200	＋ 1,600	＋ 400			＋ 0			ETF買入	＋ 100	＋ 100	＋ 500	4,460,200	3,874,600	2,473,600	▲ 0.088	▲ 0.0650	▲ 0.050	0.010	22770.36	14.75	106.84 107.03
17	金	△ 0.037	△ 0.075 0.001	△ 800	＋ 8,500	＋ 7,700		CP等買入 社債等買入 被災地金融機関支援 米ドル資金供給用担保国債供給	△ 400 △ 300 △ 1,100 ＋ 23,700 ＋ 21,900			被災地金融機関支援	＋ 100	＋ 100	＋ 29,700	4,489,900	3,897,200	3,890,000	▲ 0.088	▲ 0.0650	▲ 0.045	0.010	22696.42	9.99	107.10 107.36
20	月	△ 0.035	△ 0.070 0.001	△ 1,200	△ 40,000	△ 41,200		CP等買入	△ 300 △ 300			国債買入 国債補完供給	＋ 12,400 △ 200	＋ 12,200	△ 29,300	4,460,600	3,845,900	3,843,600	▲ 0.090	▲ 0.0650	▲ 0.045	0.020	22717.48	9.18	107.03 107.57
21	火	△ 0.030	△ 0.070 0.030	△ 1,400	＋ 3,000	＋ 1,600		CP等買入 社債等買入	△ 200 △ 200 △ 400			国庫短期証券買入 CP等買入 ETF買入	＋ 25,000 ＋ 6,000 ＋ 200	＋ 31,200	＋ 32,400	4,493,100	3,878,200	3,876,000	▲ 0.085	▲ 0.0650	▲ 0.045	0.010	22884.22	11.51	107.13 107.36
22	水	△ 0.028	△ 0.070 0.001	△ 2,100	＋ 6,100	＋ 4,000		CP等買入 社債等買入 国債補完供給	△ 500 △ 100 ＋ 100 △ 500					＋ 0	＋ 3,500	4,496,600	3,882,100	3,881,600	▲ 0.090	▲ 0.0650	▲ 0.045	0.010	22751.61	10.85	106.72 106.94
27	木	△ 0.028	△ 0.070 0.001	＋ 1,000	△ 46,700	△ 45,700		共通担保(全店) CP等買入	△ 1,900 △ 700 △ 2,600		共通担保(全店)　＋ 3,100	国債買入 ETF買入	＋ 12,200 ＋ 100	＋ 15,400	△ 32,900	4,509,000	3,914,700	3,914,200	▲ 0.093	▲ 0.0650	▲ 0.045	0.015	22715.85	11.60	105.39 106.05
28	金	△ 0.026	△ 0.065 0.001	＋ 900	＋ 1,100	＋ 2,000		CP等買入	△ 400 △ 400			国債買入 社債等買入 ETF買入	＋ 2,500 ＋ 2,000 ＋ 400	＋ 4,900	＋ 6,500	4,515,500	3,924,200	3,923,800	▲ 0.090	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.020	22657.38	10.88	105.22 105.68
29	月	△ 0.023	△ 0.065 0.001	△ 300	＋ 6,700	＋ 6,400		CP等買入 社債等買入	△ 100 △ 100 △ 200			国庫短期証券買入 ETF買入	＋ 25,000 ＋ 700	＋ 25,700	＋ 31,900	4,545,800	3,949,600	3,949,200	▲ 0.090	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.015	22397.11	11.86	104.81 105.24
30	火	△ 0.020	△ 0.060 0.001	△ 200	＋ 4,400	＋ 4,200		CP等買入 国債補完供給	△ 100 ＋ 100 ＋ 0			国債買入 ETF買入	＋ 8,100 ＋ 900	＋ 9,000	＋ 13,200	4,559,000	3,944,900	3,944,800	▲ 0.088	▲ 0.0650	▲ 0.055	0.015	22339.23	13.00	104.92 105.30
31	水	△ 0.021	△ 0.060 0.001	＋ 400	＋ 10,300	＋ 10,700		CP等買入	△ 4,200 △ 4,200			CP等買入 ETF買入	＋ 6,000 ＋ 800	＋ 6,800	＋ 13,300	4,574,500	3,943,900	3,943,800	▲ 0.088	▲ 0.0650	▲ 0.060	0.010	21710.00	16.78	104.20 104.83
月中平均 (営業日ベース)		△ 0.028	—	△ 6,207	△ 245,266	△ 251,473	—	国債買入 ＋ 70,815	—		月中実績 ＋ 1,161	月中実績 ＋ 148,666		月中実績 ＋ 149,827	—	—	—	—	▲ 0.094	▲ 0.065	▲ 0.051	0.020	22529.47	11.86	106.78
月中平均 (暦日ベース)		△ 0.028	—	月末残高 1,138,986	—	—	—	国庫短期証券買入 ＋ 135,124	—		月末残高 ＋ 3,061	月末残高 ＋ 1,625,604		月末残高 ＋ 1,628,665	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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) 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) TDB918、919、921、923、925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(余利換算値)、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