UEDA YAGI MONTHLY DATA ＜2020年10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11月2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	ユーロ円		新発	日経	東証	為替
		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	3か月物 注3)	TIBOR 3か月物 注4)	金利先物 3か月物 注5)	10年国債 注6)	平均株価	一部売買高(億株)	円相場 注7)
1	木	△ 0.031	△ 0.070 0.001	△ 1,000	△ 30,100	△ 31,100		CP等買入 国債補完供給	△ 300 ＋ 2,400	＋ 2,100		国債買入 ETF買入 国債補完供給	＋ 4,600 ＋ 800 △ 300	＋ 5,100	△ 23,900	4,850,700	4,232,100	4,232,100	▲ 0.177	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.020	23185.12	－	105.41 105.55
2	金	△ 0.022	△ 0.070 0.001	＋ 0	△ 72,300	△ 72,300		CP等買入 国債補完供給 米ドル資金供給用担保国債供給	△ 300 ＋ 300 ＋ 1,600	＋ 1,600		ETF買入	＋ 200	＋ 200	△ 70,500	4,780,200	4,195,300	4,195,200	▲ 0.177	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.015	23029.90	14.84	104.95 105.66
5	月	△ 0.019	△ 0.070 0.001	＋ 900	△ 30,200	△ 29,300		共通担保(全店) CP等買入	△ 3,800 △ 400	△ 4,200	共通担保(全店) ＋ 2,300	国債買入 国債補完供給	＋ 5,800 △ 400	＋ 7,700	△ 25,800	4,754,400	4,201,200	4,201,100	▲ 0.145	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.020	23312.14	10.46	105.43 105.64
6	火	△ 0.014	△ 0.065 0.001	＋ 1,100	＋ 7,500	＋ 8,600		CP等買入 国債補完供給	△ 100 ＋400	＋ 300		国債買入	＋ 8,500	＋ 8,500	＋ 17,400	4,771,800	4,203,800	4,203,700	▲ 0.145	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.030	23433.73	9.89	105.62 105.78
7	水	△ 0.010	△ 0.060 0.001	＋ 500	△ 8,300	△ 7,800				＋ 0		国庫短期証券買入 ETF買入 国債補完供給	＋ 10,000 ＋ 1,100 △ 500	＋ 10,600	＋ 2,800	4,774,600	4,207,300	4,207,300	▲ 0.145	▲ 0.0550	▲ 0.055	0.035	23422.82	9.32	105.61 105.94
8	木	△ 0.008	△ 0.055 0.001	＋ 0	＋ 1,500	＋ 1,500		CP等買入 国債補完供給	△ 200 ＋ 500	＋ 300		国債買入 社債等買入 ETF買入	＋ 4,000 ＋ 3,000 ＋400	＋ 7,400	＋ 9,200	4,783,800	4,218,700	4,218,700	▲ 0.144	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.034	23647.07	10.29	105.94 106.11
9	金	△ 0.008	△ 0.050 0.001	＋ 0	△ 28,400	△ 28,400		CP等買入 米ドル資金供給用担保国債供給	△ 400 ＋ 2,200	＋ 1,800		ETF買入 国債補完供給	＋ 500 △ 200	＋ 300	△ 26,300	4,757,500	4,210,000	4,210,000	▲ 0.144	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.029	23619.69	10.13	105.81 106.04
12	月	△ 0.016	△ 0.070 0.001	＋ 600	△ 18,400	△ 17,800		CP等買入 国債補完供給	△ 200 ＋ 200	＋ 0		国債買入 ETF買入 国債補完供給	＋ 10,000 ＋ 1,400 △ 100	＋ 11,300	△ 6,500	4,751,000	4,212,100	4,212,100	▲ 0.090	▲ 0.0550	▲ 0.045	0.025	23558.69	8.50	105.44 105.73
13	火	△ 0.020	△ 0.070 0.001	＋ 400	＋ 3,900	＋ 4,300		社債等買入 国債補完供給	△ 100 ＋ 100	＋ 0		国債補完供給	△ 1,000	△ 1,000	＋ 3,300	4,754,300	4,206,700	4,206,700	▲ 0.090	▲ 0.0550	▲ 0.045	0.025	23601.78	8.70	105.29 105.48
14	水	△ 0.020	△ 0.060 0.001	＋ 300	△ 500	△ 200		CP等買入 国債補完供給	△ 200 ＋ 1,000	＋ 800		国庫短期証券買入 国債補完供給	＋ 25,000 △ 100	＋ 24,900	＋ 25,500	4,779,800	4,233,300	4,233,300	▲ 0.090	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.026	23626.73	9.67	105.31 105.51
15	木	△ 0.014	△ 0.055 0.001	△ 700	＋ 71,800	＋ 71,100		CP等買入 国債補完供給	△ 700 ＋ 100	△ 600		国債買入 CP等買入	＋ 12,300 ＋ 6,000	＋ 18,300	＋ 88,800	4,868,600	4,313,000	4,313,000	▲ 0.090	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.020	23507.23	8.88	105.12 105.32
16	金	△ 0.033	△ 0.080 0.001	＋ 0	＋ 1,100	＋ 1,100		CP等買入 社債等買入 被災地金融機関支援	△ 300 △ 200 △ 100	△ 600		被災地金融機関支援 国債補完供給	＋ 100 △ 100	＋ 0	＋ 500	4,869,100	4,246,900	4,229,600	▲ 0.090	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.020	23410.63	9.17	105.19 105.43
19	月	△ 0.031	△ 0.075 0.001	△ 300	△ 16,900	△ 17,200		共通担保(全店) CP等買入 国債補完供給	△ 2,300 △ 300 ＋ 100	△ 2,500	共通担保(全店) ＋ 2,800	国債補完供給	△ 200	＋ 2,600	△ 17,100	4,852,000	4,237,600	4,233,700	▲ 0.093	▲ 0.0550	▲ 0.060	0.020	23671.13	8.62	105.35 105.50
20	火	△ 0.022	△ 0.070 0.001	△ 300	△ 17,800	△ 18,100		CP等買入 国債補完供給	△ 200 ＋ 200	＋ 0				＋ 0	△ 18,100	4,833,900	4,216,200	4,213,600	▲ 0.093	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.020	23567.04	9.23	105.44 105.61
21	水	△ 0.019	△ 0.070 0.001	△ 700	△ 12,800	△ 13,500		CP等買入	△ 200	△ 200		国債補完供給	△ 100	△ 100	△ 13,800	4,820,100	4,208,400	4,206,300	▲ 0.093	▲ 0.0550	▲ 0.040	0.030	23639.46	9.43	105.02 105.52
22	木	△ 0.017	△ 0.070 0.001	△ 1,600	＋ 2,900	＋ 1,300		CP等買入 国債補完供給	△ 200 ＋ 100	△ 100		国庫短期証券買入 国債買入 社債等買入 国債補完供給	＋ 20,000 ＋ 12,600 ＋ 2,000 △ 300	＋ 34,300	＋ 35,500	4,855,600	4,244,200	4,243,700	▲ 0.093	▲ 0.0550	▲ 0.040	0.030	23474.27	8.63	104.48 104.75
23	金	△ 0.012	△ 0.070 0.001	△ 900	＋ 13,600	＋ 12,700		CP等買入 社債等買入 国債補完供給	△ 300 △ 600 ＋ 300	△ 600		国債補完供給 新型コロナ対応金融支援特別	△ 500 ＋ 27,600	＋ 27,100	＋ 39,200	4,894,800	4,279,800	4,279,500	▲ 0.093	▲ 0.0550	▲ 0.035	0.035	23516.59	9.67	104.65 104.93
26	月	△ 0.016	△ 0.065 0.001	△ 100	△ 45,600	△ 45,700		CP等買入 国債補完供給	△ 100 ＋ 500	＋ 400		ETF買入 国債補完供給	＋ 200 △ 700	△ 500	△ 45,800	4,849,000	4,272,100	4,271,700	▲ 0.082	▲ 0.0550	▲ 0.040	0.030	23494.34	8.08	104.66 104.97
27	火	△ 0.019	△ 0.065 0.001	△ 100	＋ 5,400	＋ 5,300		CP等買入 国債補完供給	△ 200 ＋ 700	＋ 500		国債買入 ETF買入 国債補完供給	＋ 9,400 ＋ 300 △ 200	＋ 9,500	＋ 15,300	4,864,300	4,273,900	4,273,500	▲ 0.088	▲ 0.0550	▲ 0.045	0.025	23485.80	9.45	104.68 104.89
28	水	△ 0.024	△ 0.065 0.001	△ 500	＋ 2,400	＋ 1,900		CP等買入 国債補完供給	△ 200 ＋ 200	＋ 0		国庫短期証券買入 ETF買入 国債補完供給	＋ 25,000 ＋ 200 △ 300	＋ 24,900	＋ 26,800	4,891,100	4,288,300	4,288,000	▲ 0.090	▲ 0.0550	▲ 0.050	0.020	23418.51	11.83	104.16 104.56
29	木	△ 0.026	△ 0.065 0.001	△ 900	＋ 300	△ 600		CP等買入 国債補完供給	△ 200 ＋ 300	＋ 100		CP等買入 国債補完供給	＋ 6,000 △ 200	＋ 5,800	＋ 5,300	4,896,400	4,279,200	4,278,900	▲ 0.090	▲ 0.0550	▲ 0.040	0.025	23331.94	10.12	104.27 104.50
30	金	△ 0.029	△ 0.150 0.001	△ 500	＋ 1,200	＋ 700		CP等買入 社債等買入 国債補完供給	△ 4,700 △ 100 ＋ 200	△ 4,600		ETF買入	＋ 700	＋ 700	△ 3,200	4,893,200	4,273,600	4,273,600	▲ 0.094	▲ 0.0550	▲ 0.040	0.035	22977.13	13.13	104.13 104.63
月中平均 (営業日ベース)		△ 0.020	—	△ 3,620	△ 170,034	△ 173,654	—	国債買入 ＋ 67,391		—	月中実績 △ 1,000	月中実績 ＋ 45,796		月中実績 ＋ 44,796	—	—	—	—	▲ 0.111	▲ 0.055	▲ 0.047	0.026	23451.44	9.91	105.23
月中平均 (暦日ベース)		△ 0.020	—	月末残高 1,139,348	—	—	—	国庫短期証券買入 ＋ 80,054		—	月末残高 ＋ 2,801	月末残高 ＋ 1,932,968		月末残高 ＋ 1,935,769	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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)TDB940、941、943、944、947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