

オペレーション (2010年1月)

2010年2月5日
日本銀行金融市場局

短期資金オペレーション (国庫短期証券買入・売却オペレーションを除く)

(億円、年%)

オフター日	種類	実行日	期日	オフター額 (a)	応札額	落札額	按分・全取レート (b)(d)(e)	平均落札レート (d)(e)	按分比率
2010									
1/4	国債買現先	1/6	1/7	15,000	52,716	15,004	0.100	0.109	6.4
4	国債買現先	1/6	1/14	6,000	24,003	6,002	0.110	0.111	39.4
4	共通担保資金供給・全(固定)(注1)	1/6	4/2	8,000	64,550	8,014	0.100	0.100	12.4
5	C P 買現先	1/7	2/4	4,000	6,720	3,970	0.100	0.106	38.7
5	国債買現先	1/7	1/8	12,000	37,245	12,001	0.100	0.109	4.9
5	国債買現先	1/7	1/15	6,000	20,566	6,003	0.110	0.110	40.3
5	共通担保資金供給・本(金利)	1/6	1/13	6,000	19,065	6,001	0.100	0.108	8.0
6	国債買現先	1/8	1/12	10,000	32,694	10,004	0.110	0.110	71.5
6	国債買現先	1/8	1/18	6,000	21,576	6,007	0.110	0.111	37.3
6	共通担保資金供給・本(金利)	1/7	1/14	8,000	28,140	8,004	0.110	0.110	92.1
7	C P 買現先	1/12	1/25	4,000	6,430	3,950	0.100	0.107	33.9
7	国債買現先	1/12	1/13	20,000	47,658	20,008	0.110	0.110	53.8
7	国債買現先	1/12	1/19	6,000	21,860	6,002	0.110	0.110	34.0
7	企業金融支援特別(注2)	1/13	4/1		3,350	3,350	0.100 *	0.100	
7	共通担保資金供給・本(金利)	1/8	1/15	12,000	28,064	12,005	0.100	0.101	38.9
7	共通担保資金供給・本(金利)	1/12	3/23	8,000	31,500	8,005	0.110	0.110	41.8
8	国債買現先	1/13	1/14	18,000	38,592	18,005	0.100	0.108	15.3
8	国債買現先	1/13	1/20	6,000	21,297	6,001	0.110	0.110	41.3
8	共通担保資金供給・全(金利)	1/12	1/18	10,000	22,960	10,006	0.100	0.105	30.8
12	C P 買現先	1/14	1/28	4,000	6,076	3,941	0.100	0.104	53.4
12	国債買現先	1/14	1/15	15,000	29,963	15,006	0.100	0.107	22.5
12	国債買現先	1/14	1/21	6,000	18,929	6,001	0.110	0.112	48.4
12	共通担保資金供給・本(金利)	1/13	1/19	4,000	13,220	4,007	0.100	0.109	2.7
13	国債買現先	1/15	1/18	12,000	38,477	12,004	0.110	0.110	85.0
13	国債買現先	1/15	1/22	6,000	20,284	6,005	0.110	0.111	30.7
13	共通担保資金供給・本(金利)	1/14	1/20	8,000	18,400	8,006	0.100	0.100	42.3
13	共通担保資金供給・本(金利)	1/14	1/25	8,000	26,050	8,009	0.100	0.107	10.5
13	共通担保資金供給・全(固定)(注1)	1/15	4/7	8,000	71,420	8,009	0.100	0.100	11.2
14	C P 買現先	1/18	3/1	4,000	4,029	4,029	0.100 *	0.100	
14	国債買現先	1/18	1/19	12,000	34,737	12,004	0.110	0.110	64.5
14	国債買現先	1/18	1/25	6,000	19,552	6,003	0.110	0.111	55.1
14	企業金融支援特別(注2)	1/19	4/8		3,376	3,376	0.100 *	0.100	
14	共通担保資金供給・全(金利)	1/15	1/26	8,000	22,830	8,004	0.100	0.102	30.0
14	共通担保資金供給・全(金利)	1/18	5/18	10,000	40,170	10,010	0.100	0.110	2.9
15	国債買現先	1/19	1/20	10,000	29,663	10,007	0.100	0.108	10.0
15	国債買現先	1/19	1/26	6,000	15,891	6,002	0.100	0.108	11.6
15	共通担保資金供給・本(金利)	1/18	1/27	4,000	11,801	4,007	0.100	0.103	27.5
18	国債買現先	1/20	1/21	8,000	31,732	8,006	0.100	0.109	2.2
18	国債買現先	1/20	1/27	6,000	19,578	6,005	0.100	0.106	16.6
18	共通担保資金供給・本(金利)	1/19	1/25	4,000	9,200	4,003	0.100	0.100	43.5
18	共通担保資金供給・全(固定)(注1)	1/20	4/15	8,000	66,196	8,017	0.100	0.100	12.1
19	C P 買現先	1/21	2/18	4,000	3,665	3,665	0.100 *	0.103	
19	国債買現先	1/21	1/22	6,000	19,685	6,004	0.110	0.110	83.6
19	国債買現先	1/21	1/28	6,000	20,630	6,002	0.100	0.102	24.2
19	共通担保資金供給・本(金利)	1/20	1/26	6,000	9,800	6,005	0.100	0.100	61.3
19	共通担保資金供給・本(金利)	1/20	1/29	8,000	19,100	8,004	0.100	0.100	41.9
20	国債買現先	1/22	1/25	4,000	10,357	4,001	0.100	0.108	14.3
20	国債買現先	1/22	1/29	6,000	18,100	6,003	0.100	0.101	29.9
20	企業金融支援特別(注2)	1/25	4/16		5,345	5,345	0.100 *	0.100	
20	共通担保資金供給・本(金利)	1/21	1/28	10,000	20,400	10,003	0.100	0.100	55.9
20	共通担保資金供給・本(金利)	1/22	3/23	8,000	28,100	8,012	0.100	0.102	24.7
21	C P 買現先	1/25	2/8	4,000	3,773	3,773	0.100 *	0.100	
21	国債買現先	1/25	1/26	4,000	14,583	4,183	0.110 *	0.110	
21	国債買現先	1/25	2/1	6,000	16,911	6,003	0.100	0.108	13.1
21	共通担保資金供給・本(金利)	1/22	2/1	10,000	14,540	10,004	0.100	0.100	84.5
21	共通担保資金供給・本(金利)	1/22	2/8	10,000	17,900	10,007	0.100	0.100	57.3
22	国債買現先	1/26	1/27	4,000	12,544	4,006	0.100	0.106	17.1
22	国債買現先	1/26	2/2	6,000	20,085	6,007	0.100	0.104	20.4
22	共通担保資金供給・全(金利)	1/25	2/2	12,000	18,684	12,000	0.100	0.100	65.0
22	共通担保資金供給・全(金利)	1/26	4/23	8,000	36,218	8,012	0.100	0.102	18.9
25	国債買現先	1/27	2/3	8,000	26,173	8,008	0.100	0.105	19.8
25	共通担保資金供給・本(金利)	1/26	2/8	12,000	16,869	12,007	0.100	0.100	77.7
25	共通担保資金供給・全(固定)(注1)	1/27	4/27	8,000	59,918	8,009	0.100	0.100	13.4
26	C P 買現先	1/28	2/10	4,000	4,005	4,005	0.100 *	0.100	
26	国債買現先	1/28	2/4	8,000	20,693	8,004	0.100	0.101	40.4
26	共通担保資金供給・本(金利)	1/27	2/9	6,000	8,734	6,004	0.100	0.100	82.8
26	共通担保資金供給・本(金利)	1/28	3/23	8,000	14,841	8,004	0.100	0.100	61.6
27	国債買現先	1/29	2/5	8,000	17,639	8,007	0.100	0.100	50.4
27	企業金融支援特別(注2)	2/1	4/28		2,659	2,659	0.100 *	0.100	
27	共通担保資金供給・本(金利)	1/28	2/10	6,000	9,451	6,003	0.100	0.100	91.2
28	C P 買現先	2/1	3/15	4,000	4,109	4,109	0.100 *	0.100	
28	国債買現先	2/1	2/8	8,000	18,579	8,006	0.100	0.100	47.3
28	共通担保資金供給・本(金利)	1/29	2/4	4,000	11,389	4,004	0.100	0.105	23.6
28	共通担保資金供給・本(金利)	2/3	2/12	8,000	13,274	8,003	0.100	0.100	62.5
29	国債買現先	2/2	2/9	8,000	17,529	8,004	0.100	0.100	51.4
29	共通担保資金供給・全(金利)	2/1	2/15	6,000	18,095	6,006	0.100	0.100	32.4
29	共通担保資金供給・全(金利)	2/2	5/6	8,000	43,360	8,009	0.100	0.100	17.8

(注1) 貸付利率は0.10%。(注2) 当初貸付利率は0.10%。

国庫短期証券買入・売却オペレーション

(億円、年%)

オファー日	種 類	実行日	オファー額 (a)	応札額	落札額	按分・ 全取利回較差 (c)	平均落札 利回較差	按分比率
2010								
1/8	国庫短期証券買入	1/14	4,000	17,864	4,001	-0.002	0.000	30.8
14	国庫短期証券買入	1/19	4,000	17,224	4,002	-0.003	-0.002	27.8
21	国庫短期証券買入	1/26	4,000	18,375	4,001	-0.002	-0.001	30.0
29	国庫短期証券買入	2/3	4,000	20,828	4,002	-0.002	-0.001	39.7

米ドル資金供給オペレーション

(百万米ドル、年%)

オファー日	種 類	実行日	期 日	オファー額 (a)	応札額	落札額	按分・ 全取レート (b)	平均落札レート	按分比率
2010									
1/12	米ドル資金供給(注)	1/14	2/12		100	100	1.150 *	1.150	

(注) 固定金利方式。貸付利率は1.150%。

(参考1) 国債買入・売却オペ

国債買入オペ(1月): 7日(残存期間1年以下)/3,100億円オファー・13日/3,102億円実行、(残存期間1年超10年以下)/2,500億円オファー・13日/2,507億円実行、
15日(残存期間1年超10年以下)/2,500億円オファー・20日/2,503億円実行、(残存期間10年超30年以下)/1,000億円オファー・20日/1,002億円実行、
20日(残存期間1年以下)/3,100億円オファー・25日/3,100億円実行、(残存期間1年超10年以下)/2,500億円オファー・25日/2,506億円実行、
25日(残存期間1年超10年以下)/2,500億円オファー・28日/2,505億円実行、(物価連動債)/400億円オファー・28日/401億円実行。

(参考2) 国債補完供給

1月: 12日/36億円オファー(銘柄: 変動利付国債33回)・5億円実行(同)。

- 実行日に*のあるものは、オファー日と実行日が同日のオペレーション。
- 種類のうち、「共通担保資金供給」については「本」は本店、「全」は全店、「金利」は金利入札方式、「固定」は固定金利方式を示す。
- (a) オファー額は程度。但し、オペの種類が、米ドル資金供給(固定金利方式)の場合は、適格担保の範囲内で制限を設けない。
また、オペの種類が企業金融支援特別の場合は、民間企業債務の担保価額の範囲内で制限を設けない。
(b) *のないものは按分レート、*のあるものは全取レート。
(c) 売買対象先が売買の際に希望する利回りから、本行が市場実勢相場等を勘案して国庫短期証券の銘柄ごとに定めた利回りを差し引いて得た値(利回較差)を入札に付する。
*のないものは按分利回較差、*のあるものは全取利回較差。
(d) オペの種類が企業金融支援特別の場合は、当初貸付利率。
(e) オペの種類が共通担保資金供給(本店、全店)の場合は、貸付利率。
- 国債補完供給のうち、*のない銘柄の期日はオファー日の翌営業日、*のある銘柄の期日は、オファー日の4営業日後。
- 米ドル資金供給の場合の実行日および期日は米国東部時間。

問い合わせ先
金融市場局金融市場調節担当 (直通 03-3277-1284、1352) (代表 03-3279-1111<内線2711、2832>)