

オペレーション (2011年1月)

2011年2月7日
日本銀行金融市場局

オペレーション (国債買入、国庫短期証券買入・売却、米ドル資金供給、資産買入等の基金の運営として行うオペレーションを除く)

(億円、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
2011									
1/4	共通担保資金供給・本(金利)	1/5	1/12	8,000	3,400	3,400	0.100 *	0.100	
5	共通担保資金供給・本(金利)	1/6	1/17	6,000	2,600	2,600	0.100 *	0.100	
5	共通担保資金供給・全(金利)	1/7	2/9	8,000	11,813	8,003	0.100	0.100	67.7
5	共通担保資金供給・全(金利)	1/12	2/16	8,000	18,750	8,003	0.100	0.100	42.1
6	共通担保資金供給・全(金利)	1/11	2/10	10,000	11,150	10,005	0.100	0.103	85.4
7	共通担保資金供給・全(金利)	1/12	2/24	10,000	5,660	5,660	0.100 *	0.100	
11	共通担保資金供給・本(金利)	1/12	1/20	6,000	4,678	4,678	0.100 *	0.100	
11	共通担保資金供給・全(金利)	1/13	2/14	10,000	6,919	6,919	0.100 *	0.100	
12	共通担保資金供給・全(金利)	1/14	2/17	10,000	12,331	10,007	0.100	0.100	81.2
13	共通担保資金供給・本(金利)	1/14	1/31	6,000	6,000	6,000	0.100 *	0.100	
13	共通担保資金供給・全(金利)	1/17	2/22	12,000	16,613	12,007	0.100	0.100	72.3
14	共通担保資金供給・全(金利)	1/18	2/15	10,000	4,001	4,001	0.100 *	0.100	
14	共通担保資金供給・全(金利)	1/20	2/28	8,000	5,200	5,200	0.100 *	0.100	
17	共通担保資金供給・全(金利)	1/19	2/18	8,000	1,517	1,517	0.100 *	0.100	
19	共通担保資金供給・全(金利)	1/21	2/23	12,000	5,697	5,697	0.100 *	0.100	
20	共通担保資金供給・全(金利)	1/24	2/14	12,000	9,390	9,390	0.100 *	0.100	
21	共通担保資金供給・全(金利)	1/25	2/24	12,000	11,197	11,197	0.100 *	0.100	
24	共通担保資金供給・全(金利)	1/26	2/15	14,000	7,196	7,196	0.100 *	0.100	
25	共通担保資金供給・全(金利)	1/27	2/28	12,000	4,370	4,370	0.100 *	0.100	
26	共通担保資金供給・全(金利)	1/28	2/18	10,000	6,133	6,133	0.100 *	0.100	
27	共通担保資金供給・全(金利)	1/31	2/21	14,000	13,116	13,116	0.100 *	0.100	
27	共通担保資金供給・全(金利)	2/2	3/3	8,000	6,580	6,580	0.100 *	0.100	
28	共通担保資金供給・全(金利)	2/1	2/28	14,000	8,572	8,572	0.100 *	0.100	
31	共通担保資金供給・全(金利)	2/2	2/25	14,000	1,695	1,695	0.100 *	0.100	
31	共通担保資金供給・全(金利)	2/4	3/7	10,000	3,865	3,865	0.100 *	0.100	

国債買入、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 (価格)較差 (c)	平均落札利回 (価格)較差	按分比率
2011								
1/5	国庫短期証券買入	1/11	3,000	12,997	3,002	-0.010	-0.009	38.0
5	国債買入(残存期間1年以下)	1/11	3,100	8,839	3,100	0.012	0.015	96.8
5	国債買入(残存期間1年超10年以下)	1/11	2,500	7,324	2,509	0.006	0.007	47.8
12	国債買入(残存期間1年超10年以下)	1/17	2,500	6,520	2,506	0.012	0.013	91.5
12	国債買入(残存期間10年超30年以下)	1/17	1,000	3,935	1,004	0.013	0.016	22.8
17	国債買入(残存期間1年以下)	1/20	3,100	6,610	3,100	0.012 *	0.012	
17	国債買入(残存期間1年超10年以下)	1/20	2,500	9,447	2,504	0.027	0.028	49.8
21	国債買入(残存期間1年超10年以下)	1/26	2,500	5,422	2,501	0.007	0.012	36.1
21	国債買入(物価連動債)	1/26	400	498	400	0.480	0.031	23.3
24	国庫短期証券買入	1/27	3,000	15,130	3,003	0.000	0.000	75.0

* 上記表中の利回(価格)較差とは、売買対象先が売買の際に希望する利回り(価格)から、本行が市場実勢相場等を勘案して銘柄ごとに定めた利回り(価格)を差し引いて得た値。
なお、オペの種類が、国債買入(変動利付債、物価連動債)の場合は価格較差を示す(単位は円)。

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
2011									
1/25	米ドル資金供給(注)	1/27	4/21		0	0			

(注)固定金利方式。貸付利率は1.180%。

(参考) 国債補充供給
1月: 該当なし

■資産買入等の基金の運営として行うオペレーション（共通担保資金供給オペレーション）

(億円、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
2011									
1/5	共通担保資金供給	1/7	4/5	8,000	27,317	8,007	0.100	0.100	29.3
7	共通担保資金供給	1/12	4/1	8,000	30,395	8,014	0.100	0.100	26.4
11	共通担保資金供給	1/13	4/13	8,000	24,547	8,004	0.100	0.100	32.6
12	共通担保資金供給	1/14	4/8	8,000	30,080	8,005	0.100	0.100	26.6
13	共通担保資金供給	1/17	7/11	8,000	33,800	8,013	0.100	0.100	23.7
17	共通担保資金供給	1/19	4/15	8,000	22,570	8,004	0.100	0.100	35.5
19	共通担保資金供給	1/21	4/20	8,000	26,850	8,005	0.100	0.100	29.8
24	共通担保資金供給	1/26	4/22	8,000	29,590	8,009	0.100	0.100	27.1
26	共通担保資金供給	1/28	4/26	8,000	23,355	8,004	0.100	0.100	34.3
31	共通担保資金供給	2/2	4/28	8,000	26,760	8,003	0.100	0.100	29.9

■資産買入等の基金の運営として行うオペレーション（共通担保資金供給オペレーションを除く）

(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 (d)	平均落札 利回較差	按分比率
2011								
1/14	C P等買入	1/19	1,000	4,190	1,000	0.025*	0.027	
18	国庫短期証券買入	1/21	1,500	8,825	1,501	0.037	0.037	80.5
21	指数連動型上場投資信託受益権買入				146			
28	国債買入	2/2	1,500	5,467	1,501	0.091	0.092	66.8
28	指数連動型上場投資信託受益権買入				146			
28	不動産投資法人投資口買入				24			
31	指数連動型上場投資信託受益権買入				146			

・上記表中の利回較差とは、売買対象先が売買の際に希望する利回りから、本行が売買利回りの下限として定める利回り（下限利回り年0.1%）を差し引いて得た値。

・指数連動型上場投資信託受益権買入および不動産投資法人投資口買入については、信託の受託者を通じた買入約定額を落札額の項に記載。また、オファー日は約定日を示す。

1. 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。
2. 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。
3. (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。
(b)*のないものは按分レート、*のあるものは全取レート。
(c)*のないものは按分利回(価格)較差、*のあるものは全取利回(価格)較差。
(d)*のないものは按分利回較差、*のあるものは全取利回較差。
4. 国債補充供給のうち、*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。
5. 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。

問合わせ先
金融市場局市場調節課 (直通 03-3277-1284、1352) (代表 03-3279-1111<内線2711、2832>)