

オペレーション (2011年9月)

2011年10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、被災地金融機関を支援するための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	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									
9/1	共通担保資金供給・本(金利)	9/5	9/26	10,000	19,244	10,003	0.100	0.100	52.0
2	共通担保資金供給・本(金利)	9/6	9/29	10,000	13,270	10,007	0.100	0.100	75.4
7	共通担保資金供給・本(金利)	9/9	10/3	10,000	22,038	10,006	0.100	0.100	45.4
8	共通担保資金供給・全(金利)	9/12	10/14	12,000	25,470	12,010	0.100	0.100	47.2
9	共通担保資金供給・本(金利)	9/13	10/5	8,000	28,582	8,003	0.100	0.100	28.0
15	共通担保資金供給・全(金利)	9/20	10/24	14,000	35,810	14,014	0.100	0.100	39.1
16	共通担保資金供給・本(金利)	9/21	10/14	10,000	29,720	10,010	0.100	0.100	33.7
22	共通担保資金供給・本(金利)	9/27	10/17	14,000	47,370	14,012	0.100	0.100	29.6
28	共通担保資金供給・全(金利)	9/30	10/18	14,000	33,144	14,010	0.100	0.100	42.3
29	共通担保資金供給・本(金利)	10/3	10/27	10,000	30,672	10,005	0.100	0.100	32.6

■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								
9/5	国債買入(残存期間1年以下)	9/8	3,100	4,265	3,100	-0.005	-0.003	3.9
5	国債買入(残存期間1年超10年以下)	9/8	2,500	14,753	2,509	0.002	0.003	28.7
14	国債買入(残存期間1年超10年以下)	9/20	2,500	13,205	2,505	0.000	0.001	7.8
14	国債買入(残存期間10年超30年以下)	9/20	1,000	2,107	1,006	0.000	0.004	44.8
20	国債買入(残存期間1年以下)	9/26	3,100	8,369	3,104	0.000	0.000	50.0
20	国債買入(残存期間1年超10年以下)	9/26	2,500	11,600	2,508	-0.002	-0.001	53.4
26	国債買入(残存期間1年超10年以下)	9/29	2,500	13,221	2,501	-0.003	0.000	9.8
26	国債買入(物価連動債)	9/29	400	874	401	-0.130	-0.166	51.3

・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									
9/6	米ドル資金供給(注1)	9/8	9/15		0	0			
6	米ドル資金供給(注2)	9/8	12/1		0	0			
13	米ドル資金供給(注3)	9/15	9/22		0	0			
20	米ドル資金供給(注4)	9/22	9/29		0	0			
27	米ドル資金供給(注1)	9/29	10/6		0	0			

(注1)固定金利方式。貸付利率は1.110%。(注2)固定金利方式。貸付利率は1.100%。(注3)固定金利方式。貸付利率は1.120%。(注4)固定金利方式。貸付利率は1.090%。

(参考) 国債補完供給

9月：15日/277億円オファー(銘柄：物価連動国債9回)・2億円実行(同)

■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	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								
9/1	9/5	2012/3/5	8,000	8,290	8,002	0.100	0.100	96.5
5	9/7	12/7	8,000	13,480	8,005	0.100	0.100	59.4
6	9/8	12/8	8,000	14,300	8,006	0.100	0.100	56.0
12	9/14	12/13	8,000	18,880	8,010	0.100	0.100	42.4
13	9/15	12/15	8,000	19,450	8,008	0.100	0.100	41.2
14	9/16	2012/3/16	8,000	10,140	8,004	0.100	0.100	78.9
20	9/22	12/21	8,000	19,510	8,004	0.100	0.100	41.0
21	9/26	12/22	8,000	21,400	8,007	0.100	0.100	37.4
26	9/28	12/27	8,000	19,070	8,004	0.100	0.100	42.0
27	9/29	2012/4/2	8,000	17,650	8,009	0.100	0.100	45.4
28	9/30	2012/1/4	8,000	17,190	8,007	0.100	0.100	46.6

■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								
9/2	指数連動型上場投資信託受益権買入				223			
5	指数連動型上場投資信託受益権買入				223			
6	社債等買入	9/12	1,500	2,212	1,498	0.034	0.053	35.7
6	指数連動型上場投資信託受益権買入				223			
9	不動産投資法人投資口買入				17			
12	指数連動型上場投資信託受益権買入				223			
12	不動産投資法人投資口買入				17			
13	C P等買入	9/16	3,000	5,833	2,939	0.006	0.007	86.5
13	不動産投資法人投資口買入				17			
14	不動産投資法人投資口買入				17			
15	不動産投資法人投資口買入				17			
20	指数連動型上場投資信託受益権買入				223			
20	不動産投資法人投資口買入				17			
22	C P等買入	9/28	3,000	5,580	2,933	0.006	0.007	58.0
22	指数連動型上場投資信託受益権買入				223			
22	不動産投資法人投資口買入				17			
26	指数連動型上場投資信託受益権買入				223			
26	不動産投資法人投資口買入				17			
29	国債買入	10/4	1,500	5,480	1,501	0.021	0.023	25.3
29	不動産投資法人投資口買入				17			

・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。

■被災地金融機関を支援するための資金供給オペレーション

(億円、年%)

オファー日	実行日	期日	貸付額	貸付利率
2011				
9/21	9/28	2012/9/28	1,033	0.1

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>)