

オペレーション (2011年11月)

2011年12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									
11/2	共通担保資金供給・全(金利)	11/7	11/24	8,000	4,250	4,250	0.100 *	0.100	
2	共通担保資金供給・全(金利)	11/7	12/6	8,000	9,450	8,006	0.100	0.100	84.7
4	共通担保資金供給・全(金利)	11/8	12/15	8,000	2,260	2,260	0.100 *	0.100	
10	共通担保資金供給・本(金利)	11/14	12/5	10,000	11,585	10,008	0.100	0.100	86.4
16	共通担保資金供給・本(金利)	11/18	12/8	14,000	6,460	6,460	0.100 *	0.100	
22	共通担保資金供給・本(金利)	11/25	12/15	10,000	10,994	10,005	0.100	0.100	91.0
24	共通担保資金供給・本(金利)	11/28	12/20	12,000	6,430	6,430	0.100 *	0.100	
29	共通担保資金供給・全(金利)	12/1	12/28	12,000	9,400	9,400	0.100 *	0.100	
30	共通担保資金供給・全(金利)	12/2	12/15	12,000	2,610	2,610	0.100 *	0.100	
30	共通担保資金供給・全(金利)	12/2	2012/1/11	12,000	5,580	5,580	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								
11/4	国債買入(残存期間1年以下)	11/9	3,100	7,006	3,100	-0.001	0.001	79.9
4	国債買入(残存期間1年超10年以下)	11/9	2,500	11,880	2,513	0.001	0.002	15.9
9	国債買入(残存期間1年超10年以下)	11/14	2,500	8,336	2,510	0.006	0.006	59.7
9	国債買入(残存期間10年超30年以下)	11/14	1,000	2,437	1,004	0.000	0.004	18.5
18	国債買入(残存期間1年以下)	11/24	3,100	7,368	3,107	-0.002	0.000	82.7
18	国債買入(残存期間1年超10年以下)	11/24	2,500	11,498	2,502	0.002	0.004	73.6
24	国債買入(残存期間1年超10年以下)	11/29	2,500	13,440	2,512	0.003	0.004	15.5
24	国債買入(物価連動債)	11/29	400	949	401	0.100	0.060	31.0

・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									
11/2	米ドル資金供給(注1)	11/4	11/10		2	2			
2	米ドル資金供給(注1)	11/4	2012/1/26		100	100			
8	米ドル資金供給(注1)	11/10	11/17		1	1			
15	米ドル資金供給(注1)	11/17	11/25		0	0			
22	米ドル資金供給(注1)	11/25	12/1		1	1			
29	米ドル資金供給(注2)	12/1	12/8		1	1			
29	米ドル資金供給(注3)	12/1	2012/2/24		100	100			

(注1) 固定金利方式。貸付利率は1.100%。(注2) 固定金利方式。貸付利率は1.080%。(注3) 固定金利方式。貸付利率は1.120%。

(参考) 国債補完供給

11月: 10日/456億円オファー(銘柄: 物価連動国債12回)・8億円実行(同)

11日/452億円オファー(銘柄: 物価連動国債12回)・8億円実行(同)

15日/204億円オファー(銘柄: 30年利付国債26回)・10億円実行(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%)

オファード日	実行日	期日	オファード額 (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								
11/1	11/4	2012/2/7	8,000	18,510	8,009	0.100	0.100	43.3
2	11/7	2012/5/10	8,000	10,190	8,005	0.100	0.100	78.6
7	11/9	2012/2/9	8,000	9,755	8,004	0.100	0.100	82.1
9	11/11	2012/2/13	8,000	9,075	8,002	0.100	0.100	88.2
14	11/16	2012/2/17	8,000	16,040	8,007	0.100	0.100	49.9
15	11/17	2012/2/21	8,000	16,285	8,008	0.100	0.100	49.2
17	11/21	2012/5/22	8,000	9,965	8,008	0.100	0.100	80.4
18	11/22	2012/2/24	8,000	16,800	8,008	0.100	0.100	47.7
28	11/30	2012/2/28	8,000	16,820	8,008	0.100	0.100	47.6
30	12/2	2012/3/1	8,000	14,970	8,004	0.100	0.100	53.5

■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%)

オファード日	種類	実行日	オファード額 (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								
11/1	不動産投資法人投資口買入				7			
2	国債買入	11/8	2,500	9,391	2,501	0.034	0.035	79.8
2	指数連動型上場投資信託受益権買入				164			
2	不動産投資法人投資口買入				7			
4	C P 等買入	11/9	3,000	6,504	2,865	0.006	0.007	61.3
8	不動産投資法人投資口買入				7			
9	社債等買入	11/15	1,500	1,441	1,441	0.000*	0.018	
10	指数連動型上場投資信託受益権買入				164			
10	不動産投資法人投資口買入				7			
17	C P 等買入	11/22	3,000	7,041	2,972	0.006	0.007	35.1
17	国債買入	11/22	2,500	6,883	2,502	0.015	0.018	36.0
18	指数連動型上場投資信託受益権買入				164			
18	不動産投資法人投資口買入				7			
21	国庫短期証券買入	11/25	2,000	7,450	2,001	0.002	0.003	35.0
24	C P 等買入	11/29	3,000	6,533	2,971	0.006	0.007	13.8
30	国債買入	12/5	2,500	6,352	2,503	0.026	0.028	77.3

・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、オファード日は約定日を示す。

■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%)

オファード日	実行日	期日	貸付額	貸付利率
2011				
11/21	11/28	2012/11/28	12	0.1

1. 実行日に*のあるものは、オファード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)オファード額は程度。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ド日の翌営業日、*のある銘柄の期日は、オファード日の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>)