

オペレーション (2012年2月)

2012年3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
2012									
2/3	共通担保資金供給・全(金利)	2/7	3/9	8,000	16,740	8,005	0.100	0.100	47.8
9	共通担保資金供給・全(金利)	2/13	3/9	8,000	23,100	8,005	0.100	0.100	34.7
10	共通担保資金供給・全(金利)	2/14	3/21	8,000	27,457	8,006	0.100	0.100	29.2
13	共通担保資金供給・全(金利)	2/15	3/16	8,000	26,560	8,007	0.100	0.100	30.1
17	共通担保資金供給・全(金利)	2/21	3/23	8,000	25,510	8,008	0.100	0.100	31.4
21	共通担保資金供給・全(金利)	2/23	3/22	10,000	35,810	10,010	0.100	0.100	28.0
22	共通担保資金供給・本(金利)	2/24	3/14	8,000	30,465	8,007	0.100	0.100	26.3
23	共通担保資金供給・本(金利)	2/27	3/21	14,000	36,650	14,002	0.100	0.100	38.2
27	共通担保資金供給・全(金利)	2/29	3/26	10,000	21,270	10,008	0.100	0.100	47.1
28	共通担保資金供給・全(金利)	3/1	3/29	8,000	13,320	8,008	0.100	0.100	60.1
29	共通担保資金供給・本(金利)	3/2	3/23	10,000	22,610	10,006	0.100	0.100	44.3
29	共通担保資金供給・全(金利)	3/2	4/4	10,000	7,710	7,710	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
2012								
2/3	国債買入(残存期間1年以下)	2/8	3,100	7,434	3,106	-0.006	-0.006	63.3
3	国債買入(残存期間1年超10年以下)	2/8	2,500	9,119	2,511	0.001	0.001	66.8
8	国債買入(残存期間1年超10年以下)	2/13	2,500	8,309	2,508	0.011	0.012	59.6
8	国債買入(残存期間10年超30年以下)	2/13	1,000	4,089	1,003	0.012	0.013	14.5
17	国債買入(残存期間1年以下)	2/22	3,100	10,040	3,100	0.000	0.005	1.6
17	国債買入(残存期間1年超10年以下)	2/22	2,500	7,991	2,508	0.011	0.012	55.3
22	国債買入(残存期間1年超10年以下)	2/27	2,500	14,468	2,500	0.005*	0.005	
22	国債買入(変動利付債)	2/27	1,200	4,349	1,208	-0.060	-0.084	19.4

*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
2012									
2/7	米ドル資金供給(注1)	2/9	2/16		693	693			
7	米ドル資金供給(注1)	2/9	5/2		810	810			
14	米ドル資金供給(注2)	2/16	2/24		0	0			
22	米ドル資金供給(注3)	2/24	3/1		1	1			
28	米ドル資金供給(注1)	3/1	3/8		0	0			

(注1)固定金利方式。貸付利率は0.610%。(注2)固定金利方式。貸付利率は0.630%。(注3)固定金利方式。貸付利率は0.600%。

(参考) 国債補充供給

2月: 14日/44億円オファー(銘柄: 物価連動国債2回)・12億円実行(同)

15日/38億円オファー(銘柄: 物価連動国債2回)・12億円実行(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	
2012									
	2/1	2/3	5/8	8,000	11,275	8,004	0.100	0.100	71.0
	3	2/7	5/11	8,000	11,105	8,007	0.100	0.100	72.1
	7	2/9	5/15	8,000	14,760	8,005	0.100	0.100	54.2
	9	2/13	5/16	8,000	13,250	8,008	0.100	0.100	60.4
	13	2/15	8/9	8,000	12,106	8,006	0.100	0.100	66.1
	15	2/17	5/18	8,000	13,540	8,007	0.100	0.100	59.1
	16	2/20	8/22	8,000	7,010	7,010	0.100 *	0.100	
	17	2/21	5/24	8,000	12,730	8,006	0.100	0.100	62.9
	21	2/23	8/29	8,000	6,255	6,255	0.100 *	0.100	
	22	2/24	5/28	8,000	11,870	8,006	0.100	0.100	67.4
	24	2/28	5/29	8,000	11,460	8,006	0.100	0.100	69.9
	28	3/1	6/1	8,000	14,020	8,008	0.100	0.100	57.1

■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
2012								
	2/7 不動産投資法人投資口買入				13			
	8 社債等買入	2/14	1,500	1,593	1,503	0.000	0.008	51.6
	10 国庫短期証券買入	2/15	2,000	6,397	2,005	0.000	0.001	4.6
	13 C P 等買入	2/16	3,000	7,698	2,912	0.013	0.015	49.1
	15 国債買入	2/20	5,000	10,677	5,003	0.002	0.005	57.7
	20 国庫短期証券買入	2/23	3,000	8,782	3,008	0.000	0.001	21.9
	22 不動産投資法人投資口買入				13			
	24 C P 等買入	2/29	3,000	6,535	2,908	0.012	0.013	31.3
	27 国債買入	3/1	5,000	26,456	5,006	0.007	0.007	87.6
	28 国庫短期証券買入	3/2	3,000	8,476	3,004	0.000	0.000	29.7
	28 不動産投資法人投資口買入				13			

・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
2012				
	2/21	2013/2/27	53	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。

問い合わせ先
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>)