

オペレーション (2012年9月)

2012年10月5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
	9月該当なし								

■ 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								
9/3	国債買入(残存期間1年以下)	9/5	3,100	8,316	3,101	0.031	0.038	83.4
3	国債買入(残存期間1年超10年以下)	9/5	2,500	9,894	2,503	0.002	0.003	36.6
10	国債買入(残存期間1年超10年以下)	9/12	2,500	9,544	2,500	0.007 *	0.007	
10	国債買入(残存期間10年超30年以下)	9/12	1,000	4,599	1,003	-0.003	-0.001	22.1
21	国債買入(残存期間1年以下)	9/25	3,100	12,674	3,108	0.000	0.002	14.2
21	国債買入(残存期間1年超10年以下)	9/25	2,500	12,763	2,508	0.003	0.004	12.0
25	国債買入(残存期間1年超10年以下)	9/27	2,500	11,899	2,504	0.004	0.005	84.3
25	国債買入(物価連動債)	9/27	200	705	201	0.000	-0.048	52.0

・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
2012									
9/5	米ドル資金供給(注1)	9/7	9/13		1	1			
11	米ドル資金供給(注1)	9/13	9/20		1	1			
18	米ドル資金供給(注2)	9/20	9/27		2	2			
18	米ドル資金供給(注1)	9/20	12/13		0	0			
25	米ドル資金供給(注3)	9/27	10/4		0	0			

(注1)固定金利方式。貸付利率は0.640%。(注2)固定金利方式。貸付利率は0.660%。(注3)固定金利方式。貸付利率は0.630%。

(参考) 国債補完供給
9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	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								
9/4	9/6	2013/1/16	8,000	4,318	4,318	0.100 *	0.100	
5	9/7	2013/1/9	8,000	3,803	3,803	0.100 *	0.100	
7	9/11	2013/1/18	8,000	4,544	4,544	0.100 *	0.100	
11	9/13	2013/1/21	8,000	4,703	4,703	0.100 *	0.100	
13	9/18	2013/1/23	8,000	6,260	6,260	0.100 *	0.100	
18	9/20	2013/1/24	8,000	10,340	8,006	0.100	0.100	77.4
19	9/21	2013/1/28	8,000	10,230	8,006	0.100	0.100	78.3
21	9/25	2013/1/30	8,000	10,650	8,007	0.100	0.100	75.2
25	9/27	2013/2/4	8,000	7,655	7,655	0.100 *	0.100	
27	10/1	2013/2/5	8,000	11,160	8,004	0.100	0.100	71.7

■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								
9/4	国庫短期証券買入	9/6	6,000	32,350	6,009	0.099	0.099	30.5
6	C P 等買入	9/11	3,000	7,373	2,830	0.122	0.126	92.2
7	国債買入(残存期間1年以上2年以下)	9/11	4,000	3,425	3,425	0.000 *	0.000	
7	国債買入(残存期間2年超3年以下)	9/11	4,000	5,284	4,000	0.002	0.003	100.0
11	社債等買入	9/18	2,500	3,116	2,502	0.031	0.075	33.6
11	指数連動型上場投資信託受益権買入				255			
14	C P 等買入	9/20	3,000	6,721	2,990	0.126	0.129	57.8
14	国庫短期証券買入	9/19	6,000	39,014	6,013	0.099	0.099	12.6
20	国債買入(残存期間1年以上2年以下)	9/24	7,000	23,331	7,000	0.100 *	0.100	
20	国債買入(残存期間2年超3年以下)	9/24	3,000	8,172	3,001	0.096	0.100	9.9
20	不動産投資法人投資口買入				38			
24	C P 等買入	9/27	3,000	6,400	2,991	0.129	0.132	22.0
26	指数連動型上場投資信託受益権買入				255			
28	国債買入(残存期間1年以上3年以下)	10/2	6,000	17,889	6,002	0.100	0.101	56.6

・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。ただし、国庫短期証券買入、C P 等買入ならびに2012年9月20日以降にオファーした国債買入については、買入対象先が売買の際に希望する利回りと読み替える。

・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				
9/21	9/28	2013/9/27	808	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>)