BTMU Daily Market Report　　as of 2 Oct 2017

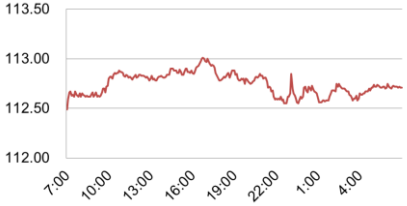
株式会社 三菱東京UFJ銀行
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ
2017年10月3日　発行

<為替四本値>

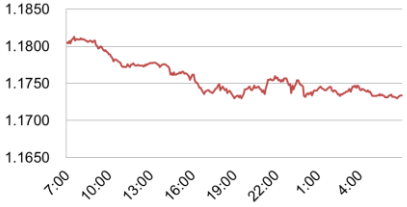
Time	CCY	USD/JPY	EUR/USD	GBP/USD	USD/CHF	EUR/JPY
TKY	Open	112.66	1.1806	1.3386	0.9685	133.05
	High	113.06	1.1806	1.3388	0.9726	133.05
	Low	112.60	1.1735	1.3323	0.9683	132.66
	Close	112.99	1.1743	1.3328	0.9719	132.67
LDN	Open	112.87	1.1764	1.3362	0.9708	132.77
	High	113.06	1.1765	1.3365	0.9736	132.77
	Low	112.54	1.1730	1.3257	0.9686	132.26
	Close	112.71	1.1736	1.3276	0.9736	132.27
NY	Open	112.84	1.1739	1.3287	0.9707	132.43
	High	112.94	1.1763	1.3298	0.9755	132.54
	Low	112.54	1.1731	1.3257	0.9686	132.20
	Close	112.75	1.1731	1.3277	0.9748	132.27

<為替相場推移>

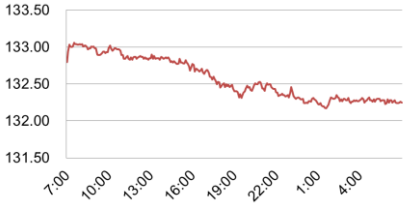
USD/JPY



EUR/USD



EUR/JPY



(出所)Thomson Reuters

<為替相場概況>
ドル円、方向感見出せず

東京市場のドル円相場は112.66で寄り付いた後、日経平均株価指数の上昇を背景に底堅く推移。欧州勢参入後には、高値113.06まで上昇した。しかし、同水準では上値も重く、続伸が阻まれると再び反落。米国時間には、安値112.54まで押し戻された。もっとも、その後は予想比良好な米ISM製造業景気指数や米建設支出、堅調な米主要株価指数（最高値更新）が下値を支え、結局112.75まで小反発して引けている。尚、ダラス連銀カプラン総裁は「12月にさらなる行動を取るべきかどうか見極めるべき」と発言したが、市場の反応は限られたものに留まった。

<金利市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
日	無担保コールO/N	-0.047%	+0.016%
日	ユーロ円金利先物	99.950p	+0.005p
日	円-LIBOR 6ヵ月	-0.00857%	+0.00036%
日	円-TIBOR 6ヵ月	0.10636%	±0.00000%
米	米国FF Rate	1.06%	-0.10%
米	米国TB 3ヵ月	1.0201%	-0.0204%
米	USD-LIBOR 6ヵ月	1.50933%	+0.00333%
ユ	EURIBOR 6ヵ月	-0.27200%	+0.00100%
英	GBP-LIBOR 6ヵ月	0.49156%	+0.00068%
瑞	CHF-LIBOR 6ヵ月	-0.64880%	±0.00000%

<債券市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
日	日本国債 2年	-0.104%	+0.017%
日	日本国債10年	0.075%	+0.007%
日	日本国債先物 10年	150.18円	-0.17円
米	米国債 2年	1.4828%	+0.0001%
米	米国債 10年	2.3408%	+0.0072%
独	独国債 2年	-0.705%	-0.013%
独	独国債 10年	0.451%	-0.013%
英	英国債 2年	0.430%	-0.037%
英	英国債 10年	1.328%	-0.037%

(出所)Bloomberg

<株式市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
日	日経平均株価 225種	20,400.78円	+44.50円
米	NYダウ工業株 30種	22,557.60$	+152.51$
米	S&P 500種	2,529.12	+9.76
独	独DAX指数	12,902.65	+73.79
英	英FT指数 100種	7,438.84	+66.08
中	上海総合指数	休場	-
伯	ボベスパ指数	74,359.83	+66.32

<商品市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
米	WTI 原油先物	50.58$	-1.09$
米	CMX 金先物	1,275.80$	-9.00$
米	CRB商品先物指数	180.9092	-2.1790

(出所)Bloomberg

<主な経済指標>

地域	イベント		市場予想	今回結果	時刻
日	日銀短観 大企業製造業業況DI	3Q	18	22	8:50
ユ	失業率	8月	9.0%	9.1%	18:00
米	ISM製造業指数	9月	58.1	60.8	23:00
米	建設支出（前月比）	8月	0.4%	0.5%	23:00

※「時刻」は東京時間、「市場予想」はBloomberg調査中央値

<本日発表予定の主な経済指標>

地域	イベント		市場予想	前回結果	時刻
ユ	生産者物価指数（前年比）	8月	2.3%	2.0%	18:00

(出所)Bloomberg

照会先：市場営業部　プロダクツ営業推進Gr

本資料は信頼出来ると思われる各種データに基づき作成しておりますが、当行はその正確性を保証するものではありません。本資料はお客さまへの情報提供のみを目的としたもので、売買の勧誘を目的としたものではありません。取引に関する決定はお客さまご自身の判断でなさいますようお願い申し上げます。また本資料は当行市場営業部 企画管理グループ リサーチライン (グローバルマーケットリサーチ)により実施される調査や同部門の見解を反映するものではありません。