BTMU Daily Market Report as of 22 Jan 2018

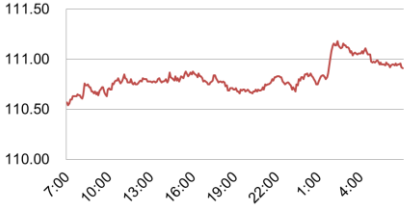
株式会社 三菱東京UFJ銀行
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ
2018年1月23日 発行

<為替四本値>

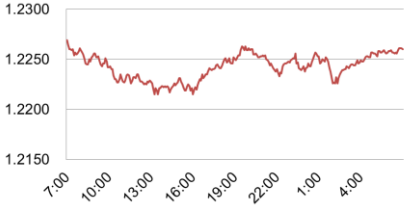
Time	CCY	USD/JPY	EUR/USD	GBP/USD	USD/CHF	EUR/JPY
TKY	Open	110.70	1.2256	1.3889	0.9615	135.67
	High	110.92	1.2257	1.3895	0.9635	135.67
	Low	110.60	1.2214	1.3857	0.9611	135.36
	Close	110.78	1.2237	1.3890	0.9612	135.58
LDN	Open	110.79	1.2237	1.3888	0.9612	135.58
	High	110.89	1.2267	1.3970	0.9617	135.80
	Low	110.67	1.2234	1.3886	0.9594	135.56
	Close	110.78	1.2254	1.3969	0.9604	135.76
NY	Open	110.84	1.2241	1.3892	0.9613	135.65
	High	111.22	1.2263	1.3991	0.9640	136.13
	Low	110.69	1.2224	1.3886	0.9603	135.60
	Close	110.92	1.2262	1.3988	0.9621	136.04

<為替相場推移>

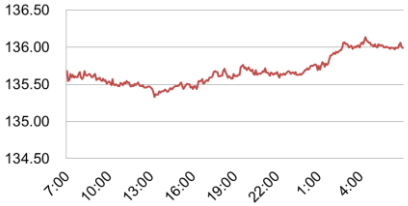
USD/JPY



EUR/USD



EUR/JPY



(出所)Thomson Reuters

<為替相場概況>

米上院で暫定予算案を巡る報道を受け、ドル円は111円台前半まで上昇

米国の一部の政府機関が閉鎖されたことを受け、東京市場のドル円相場は110.70(先週末終値110.84)までやや下落して寄り付いた。その後、米上院が暫定予算案の採決を米国時間に実施することが伝わると、日本時間から欧州時間にかけて様子見姿勢が強まり、動意に乏しい展開が継続した。一方、米国時間に、米上院が政府機関閉鎖を解除する2月8日までの暫定予算案の採決実施に必要な動議を可決したことを受け、米主要株価や米国債利回りが上昇すると、連れてドル円も高値111.22まで上昇した。結局、米上院で暫定予算が可決されたが、その後はドル売り圧力が強まり110.92で引けている。

<金利市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
日	無担保コールO/N	-0.041%	±0.000%
日	ユーロ円金利先物	99.935p	±0.000p
日	円-LIBOR 6ヵ月	0.01867%	-0.00250%
日	円-TIBOR 6ヵ月	0.12636%	±0.00000%
米	米国FF Rate	1.42%	±0.00%
米	米国TB 3ヵ月	1.4166%	-0.0103%
米	USD-LIBOR 6ヵ月	1.92550%	-0.00625%
ユ	EURIBOR 6ヵ月	-0.27700%	-0.00100%
英	GBP-LIBOR 6ヵ月	0.58124%	+0.00032%
瑞	CHF-LIBOR 6ヵ月	-0.64260%	±0.00000%

<債券市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
日	日本国債 2年	-0.132%	-0.002%
日	日本国債10年	0.079%	-0.006%
日	日本国債先物 10年	150.37円	-0.01円
米	米国債 2年	2.0608%	-0.0039%
米	米国債 10年	2.6500%	-0.0092%
独	独国債 2年	-0.605%	-0.002%
独	独国債 10年	0.567%	-0.002%
英	英国債 2年	0.571%	+0.006%
英	英国債 10年	1.358%	+0.021%

(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	23,816.33円	+8.27円
米	NYダウ工業株 30種	26,214.60$	+142.88$
米	S&P 500種	2,832.97	+22.67
独	独DAX指数	13,463.69	+29.24
英	英FT指数 100種	7,715.44	-15.35
中	上海総合指数	3,501.362	+13.498
伯	ボベスパ指数	81,675.42	+455.92

<商品市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
米	WTI 原油先物	63.94$	+0.63$
米	CMX 金先物	1,333.40$	+0.30$
米	CRB商品先物指数	196.2168	+0.7138

(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

※「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
日	日銀金融政策決定会合	-	-	-	-
世	ダボス会議(～26日)	-	-	-	-
日	黒田・日銀総裁定例会見	-	-	-	15:30
独	ZEW景況感調査(期待指数)	1月	17.7	17.4	19:00
独	ZEW景況感調査(現況)	1月	89.9	89.3	19:00
ユ	消費者信頼感指数	1月	0.6	0.5	0:00

(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。