

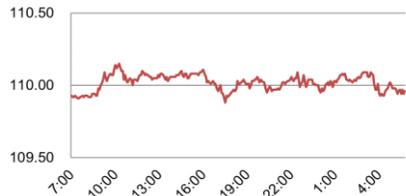
<為替四本値>

Time	CCY	USD/JPY	EUR/USD	GBP/USD	USD/CHF	EUR/JPY
TKY	Open	110.01	1.1135	1.2988	0.9710	122.50
	High	110.22	1.1144	1.3002	0.9713	122.76
	Low	109.96	1.1131	1.2965	0.9702	122.50
	Close	109.98	1.1141	1.2979	0.9702	122.54
LDN	Open	109.98	1.1142	1.2979	0.9701	122.53
	High	110.11	1.1144	1.3015	0.9710	122.53
	Low	109.89	1.1104	1.2955	0.9670	122.20
	Close	110.04	1.1122	1.3010	0.9683	122.39
NY	Open	110.05	1.1120	1.2978	0.9682	122.32
	High	110.11	1.1135	1.3034	0.9710	122.58
	Low	109.85	1.1104	1.2975	0.9666	122.20
	Close	110.00	1.1125	1.3019	0.9674	122.37

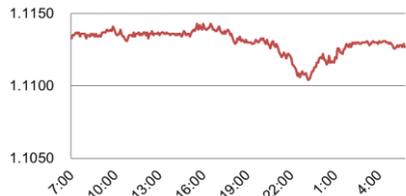
(Refinitivデータを元に当行作成)

<為替相場推移>

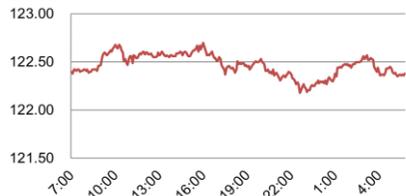
USD/JPY



EUR/USD



EUR/JPY



(出所)Refinitiv

<為替相場概況>

ドル円、昨年5月以来となる110円台

14日早朝に米財務省が中国の為替操作国認定を解除したことを受け、円売りが優勢となり、東京市場のドル円相場は110.01まで上昇して寄り付いた。寄り付き後も日経平均株価の上昇に連れて、ドル円は昨年5月以来の高値110.22を付けた。しかし、久しぶりの110円台では上値が重かったことに加え、米国の対中制裁関税をめぐる報道(後述)を受け米主要株価指数が下落に転じたことも相まって、ドル円は109円台後半まで値を下げた。取引時間の終盤でも110円絡みでの推移となり、ドル円は110.00で引けている。

米政府の対中制裁関税が大統領選挙後まで維持される見込みとの関係者の見解が示された。米国は署名後10カ月を経過してから中国による第1段階合意の順守状況を確認した上で関税を引き下げるとのこと。

また、ニューヨーク連銀は、国債などを担保に資金を供給するレポオペを少なくとも2月中旬まで継続すると表明した。このうちターム物オペについては、供給額の上限を従来の350億ドルから300億ドルに引き下げるとした。昨年10月に始めた月600億ドルの短期証券の買い入れは継続するとのこと。

(Bloombergデータを元に当行作成)

<金利市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
日	無担保コールO/N	-0.028%	+0.007%
日	ユーロ円金利先物	99.975p	±0.000p
日	円-LIBOR 6ヵ月	0.01167%	+0.00384%
日	円-TIBOR 6ヵ月	0.12636%	±0.00000%
米	米国FF Rate	1.54%	±0.00%
米	米国TB 3ヵ月	1.5514%	+0.0158%
米	USD-LIBOR 6ヵ月	1.86450%	-0.00800%
ユ	EURIBOR 6ヵ月	-0.32900%	-0.00500%
英	GBP-LIBOR 6ヵ月	0.80500%	+0.00875%
瑞	CHF-LIBOR 6ヵ月	-0.61760%	-0.00080%

※「米国FF Rate」のみ as of 13 Jan 2020

<株式市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
日	日経平均株価 225種	24,025.17円	+174.60円
米	NYダウ工業株 30種	28,939.67\$	+32.62\$
米	S&P 500種	3,283.15	-4.98
独	独DAX指数	13,456.49	+4.97
英	英FT指数 100種	7,622.35	+4.75
中	上海総合指数	3,106.820	-8.750
伯	ボベスバ指数	117,632.40	+307.10

<主な経済指標>

地域	イベント	市場予想	今回結果	時刻
日	経常収支(11月・億円)	14,233	14,368	8:50
中	貿易収支(12月・億ドル)	457	467.9	12:26
日	景気ウォッチャー調査-現状(12月)	41	39.8	14:00
日	景気ウォッチャー調査-先行き(12月)	46.8	45.4	14:00
米	消費者物価指数(前年比、12月)	2.40%	2.30%	22:30

※「時刻」は東京時間、「市場予想」はBloomberg調査中央値

<債券市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
日	日本国債 2年	-0.122%	+0.014%
日	日本国債 10年	0.016%	+0.016%
日	日本国債先物 10年	151.86円	+0.10円
米	米国債 2年	1.5700%	-0.0143%
米	米国債 10年	1.8109%	-0.0350%
独	独国債 2年	-0.581%	+0.007%
独	独国債 10年	-0.171%	-0.012%
英	英国債 2年	0.494%	+0.009%
英	英国債 10年	0.720%	-0.030%

(出所)Bloomberg

<商品市況>

地域	銘柄名	終値	前日比
米	WTI原油先物	58.14\$	+0.06\$
米	CMX金先物	1,547.00\$	-3.60\$
米	CRB商品先物指数	183.6407	+0.6316

(出所)Bloomberg

<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	黒田日銀総裁挨拶(支店長会議)	-	-	9:30
ユ	オーストリア中銀ホルツマン総裁講演	-	-	17:40
ユ	鉱工業生産(前月比、11月)	0.30%	▲0.5%	19:00
ユ	貿易収支(季調済、11月・億ユーロ)	220	245	19:00
米	生産者物価指数(前月比、12月)	0.20%	0.00%	22:30
米	ニューヨーク連銀景況指数(1月)	3.6	3.5	22:30
米	フィラデルフィア連銀ハーカー総裁講演	-	-	1:00
米	ダラス連銀カプラン総裁講演	-	-	2:00
米	地区連銀経済報告	-	-	4:00

(出所)Bloomberg

照会先: 三菱UFJ銀行 金融市場部

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。また本資料は当行金融市場部 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。