

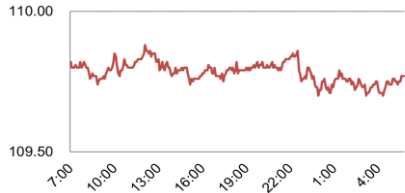
<為替四本値>

| Time | CCY   | USD/JPY | EUR/USD | GBP/USD | USD/CHF | EUR/JPY |
|------|-------|---------|---------|---------|---------|---------|
| TKY  | Open  | 109.78  | 1.0842  | 1.3045  | 0.9792  | 119.04  |
|      | High  | 109.91  | 1.0843  | 1.3060  | 0.9804  | 119.09  |
|      | Low   | 109.75  | 1.0827  | 1.3042  | 0.9792  | 118.87  |
|      | Close | 109.78  | 1.0841  | 1.3057  | 0.9804  | 119.03  |
| LDN  | Open  | 109.79  | 1.0841  | 1.3053  | 0.9805  | 119.01  |
|      | High  | 109.88  | 1.0861  | 1.3063  | 0.9818  | 119.23  |
|      | Low   | 109.70  | 1.0832  | 1.3001  | 0.9802  | 118.91  |
|      | Close | 109.76  | 1.0845  | 1.3015  | 0.9815  | 119.04  |
| NY   | Open  | 109.85  | 1.0840  | 1.3030  | 0.9812  | 119.11  |
|      | High  | 109.88  | 1.0861  | 1.3053  | 0.9822  | 119.23  |
|      | Low   | 109.70  | 1.0828  | 1.3001  | 0.9802  | 118.90  |
|      | Close | 109.77  | 1.0831  | 1.3046  | 0.9822  | 118.90  |

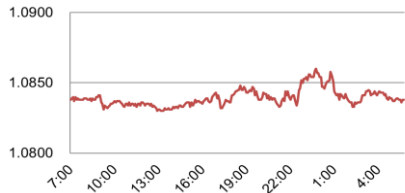
(Refinitivデータを元に当行作成)

<為替相場推移>

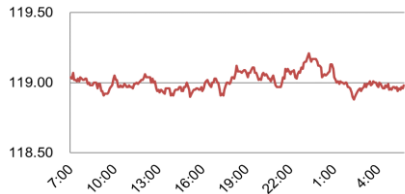
USD/JPY



EUR/USD



EUR/JPY



(出所)Refinitiv

<為替相場概況>

ドル円は109 円台後半で小動き

東京市場のドル円は109.78 で寄り付いた後、同水準で推移した。その後、米国時間に発表された1月の米小売売上高や鉱工業生産が不冴な結果となると、米国債利回りの低下に連れて、ドル円も安値109.70 を付けた。終盤にかけては、米半導体企業の決算が好調だったことや、米政権が株式投資に対する税控除を検討していると報じられたことも相まって、米主要株価指数が幾分持ち直し、ドル円は109.77 で引けている。結局、ドル円の値幅は21 銭に留まり、動意に乏しかった。

(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     | -0.011%   | -0.003%   |
| 日  | ユーロ円金利先物      | 99.985p   | ±0.000p   |
| 日  | 円-LIBOR 6ヵ月   | -0.01050% | -0.00100% |
| 日  | 円-TIBOR 6ヵ月   | 0.12636%  | ±0.00000% |
| 米  | 米国FF Rate     | 1.58%     | ±0.00%    |
| 米  | 米国TB 3ヵ月      | 1.5689%   | -0.0028%  |
| 米  | USD-LIBOR 6ヵ月 | 1.71000%  | -0.00288% |
| ユ  | EURIBOR 6ヵ月   | -0.35900% | -0.00200% |
| 英  | GBP-LIBOR 6ヵ月 | 0.80638%  | +0.00063% |
| 瑞  | CHF-LIBOR 6ヵ月 | -0.66240% | -0.00300% |

※「米国FF Rate」のみ as of 13 Feb 2020

<株式市況>

| 地域 | 銘柄名         | 終値          | 前日比       |
|----|-------------|-------------|-----------|
| 日  | 日経平均株価 225種 | 23,687.59円  | -140.14円  |
| 米  | NYダウ工業株 30種 | 29,398.08\$ | -25.23\$  |
| 米  | S&P 500種    | 3,380.16    | +6.22     |
| 独  | 独DAX指数      | 13,744.21   | -1.22     |
| 英  | 英FT指数 100種  | 7,409.13    | -42.90    |
| 中  | 上海総合指数      | 2,917.008   | +10.935   |
| 伯  | ボベスバ指数      | 114,380.70  | -1,281.70 |

<主な経済指標>

| 地域 | イベント                | 市場予想  | 今回結果  | 時刻    |
|----|---------------------|-------|-------|-------|
| ユ  | 貿易収支(季調済、12月・億ユーロ)  | 193   | 222   | 19:00 |
| 米  | 輸入物価指数(前年比、1月)      | 0.2%  | 0.3%  | 22:30 |
| 米  | 小売売上高(前月比、1月)       | 0.3%  | 0.3%  | 22:30 |
| 米  | 鉱工業生産(前月比、1月)       | ▲0.2% | ▲0.3% | 23:15 |
| 米  | 設備稼働率(1月)           | 76.8% | 76.8% | 23:15 |
| 米  | ミンガン大消費者信頼感指数(2月速報) | 99.5  | 100.9 | 0:00  |
| 米  | 企業在庫(前月比、12月)       | 0.1%  | 0.1%  | 0:00  |

※「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    | -0.132% | +0.018%  |
| 日  | 日本国債 10年   | -0.027% | +0.007%  |
| 日  | 日本国債先物 10年 | 152.54円 | +0.05円   |
| 米  | 米国債 2年     | 1.4279% | -0.0159% |
| 米  | 米国債 10年    | 1.5848% | -0.0325% |
| 独  | 独国債 2年     | -0.655% | -0.011%  |
| 独  | 独国債 10年    | -0.401% | -0.015%  |
| 英  | 英国債 2年     | 0.544%  | -0.018%  |
| 英  | 英国債 10年    | 0.628%  | -0.024%  |

(出所)Bloomberg

<商品市況>

| 地域 | 銘柄名       | 終値         | 前日比     |
|----|-----------|------------|---------|
| 米  | WTI 原油先物  | 52.05\$    | +0.63\$ |
| 米  | CMX 金先物   | 1,586.40\$ | +7.60\$ |
| 米  | CRB商品先物指数 | 172.9549   | +0.6786 |

(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  | 実質GDP(前期比年率、4Q速報) | ▲3.8% | 1.8% | 8:50  |
| ユ  | ユーロ圏財務相会合         | -     | -    | -     |
| ユ  | レーンECB専務理事講演      | -     | -    | 23:00 |
| 米  | 市場休場              | -     | -    | -     |

(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れ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。