

## 【参考】東京外為市場における取引状況（2011 年中）

2012 年 1 月 4 日

日本銀行金融市場局

| 1.相場            |                        | ドル/円                | ユーロ/ドル                     | ユーロ/円 (裁定)           |
|-----------------|------------------------|---------------------|----------------------------|----------------------|
|                 | 年初 9:00時点<br>(1/4日)    | 81.68 円             | 1.3356 ドル                  | 109.09 円             |
|                 | 年末 17:00時点<br>(12/30日) | 77.57 円             | 1.2941 ドル                  | 100.38 円             |
| 17:00時点<br>(注1) | 高値                     | 85.25 円<br>(4/7日)   | 1.4836 ドル<br>(4/28日)       | 122.86 円<br>(4/8日)   |
|                 | 安値                     | 75.84 円<br>(10/28日) | 1.2932 ドル<br>(1/11,12/29日) | 100.38 円<br>(12/30日) |
|                 | レンジ幅                   | 9.41 円              | 0.1904 ドル                  | 22.48 円              |
| 瞬間<br>(注2)      | 高値                     | 85.53 円<br>(4/6日)   | 1.4882 ドル<br>(4/28日)       | /                    |
|                 | 安値                     | 75.52 円<br>(10/31日) | 1.2887 ドル<br>(12/29日)      |                      |
|                 | レンジ幅                   | 10.01 円             | 0.1995 ドル                  |                      |
| 平均レート           | 17:00時点<br>ベース         | 79.73 円             | 1.3927 ドル                  | 111.06 円             |
|                 | 中心相場                   | 79.76 円             |                            |                      |

2 取引高 (注3)

|         |            |                          |                        |
|---------|------------|--------------------------|------------------------|
| スポット    | 1営業日当たりの平均 | 9,540 百万ドル               | 6,468 百万ドル             |
|         | 前年比        | +5.34 %                  | -4.56 %                |
|         | 最高         | 146,491 百万ドル<br>(10/31日) | 17,611 百万ドル<br>(7/12日) |
|         | 最低         | 2,525 百万ドル<br>(12/26日)   | 473 百万ドル<br>(12/26日)   |
| スワップ    | 1営業日当たりの平均 | 46,634 百万ドル              | 11,044 百万ドル            |
|         | 前年比        | +12.62 %                 | +56.43 %               |
|         | 最高         | 77,554 百万ドル<br>(11/2日)   | 27,882 百万ドル<br>(7/29日) |
|         | 最低         | 10,147 百万ドル<br>(12/26日)  | 0 百万ドル<br>(4/22日)      |
| 通貨オプション | 1営業日当たりの平均 | 466 百万ドル                 | 38 百万ドル                |
|         | 前年比        | +2.87 %                  | +15.15 %               |
|         | 最高         | 1,816 百万ドル<br>(6/30日)    | 236 百万ドル<br>(12/1日)    |
|         | 最低         | 0 百万ドル<br>(1/17,9/12日)   | 0 百万ドル<br>(多数)         |

(注1) インターバンク市場参加者等から聴取したオファー（売り気配値）とビッド（買い気配値）の中間値。

(注2) インターバンク市場で実際に取引されたレート。

(注3) 東京外国為替市場における終日分出来高（ブローカー経由分のみ）。なお、スワップにはアウトライト・フォワードを含む。

照会先

金融市場局為替課

03-3277-1345~6

以上