

みずほCustomer Desk Report 2023/12/01 号 (As of 2023/11/30)

金融市場部 為替営業第二チーム

【昨日の市況概要】

	USD/JPY	EUR/USD	EUR/JPY	公示仲値 GBP/USD	147.09 AUD/USD
TKY 9:00AM	147.04	1.0974	161.50	1.2695	0.6619
SYD-NY High	148.52	1.0984	161.93	1.2710	0.6650
SYD-NY Low	146.85	1.0879	160.61	1.2604	0.6571
NY 5:00 PM	148.21	1.0889	161.34	1.2627	0.6605

	終値	(前日比)		終値	(前日比)
NY DOW	35,950.89	520.47	日本2年債	0.0200%	▲0.0200%
NASDAQ	14,226.22	▲ 32.27	日本10年債	0.6700%	0.0000%
S&P	4,567.80	17.22	米国2年債	4.6937%	0.0492%
日経平均	33,486.89	165.67	米国5年債	4.2725%	0.0601%
TOPIX	2,374.93	10.43	米国10年債	4.3293%	0.0712%
シカゴ日経先物	33,545.00	265.00	独10年債	2.4475%	0.0250%
ロンドンFT	7,453.75	30.29	英10年債	4.1715%	0.0740%
DAX	16,215.43	48.98	豪10年債	4.3620%	▲0.0220%
ハンセン指数	17,042.88	49.44	USDJPY 1M Vol	9.09%	0.19%
上海総合	3,029.67	7.99	USDJPY 3M Vol	8.64%	0.07%
NY金	2,057.20	▲ 9.90	USDJPY 6M Vol	8.70%	0.06%
WTI	75.96	▲ 1.90	USDJPY 1M 25RR	▲1.16%	Yen Call Over
CRB指数	273.64	▲ 1.80	EURJPY 3M Vol	8.40%	0.16%
ドルインデックス	103.50	0.73	EURJPY 6M Vol	8.64%	0.10%

東京	東京時間のドル円は147.04レベルでオープン。ほどなくして高値となる147.19をつけるも、米国の早期利下げ織り込みを背景としたドル安地合いに上値が重い値動きが継続。その後は月末フローが交錯し147円を挟んで方向感なく推移。結局146.98レベルで海外時間に渡った。
ロンドン	ロンドン市場のドル円は、146.98レベルでオープン。立ち上がりドル円は反応が鈍かったが、ドルの騰勢が強まる中で147.77まで上昇した。結局147.56レベルでNYに渡った。ユーロドルは、1.0975レベルでオープン。ユーロ圏11月のCPIが予想を下回ったことで一時1.0910まで1.0926レベルでNYに渡った。(ロンドン・フリー 00531 444 179 神田)
ニューヨーク	海外市場のドル円は147円台前半でスタート。147.10付近での推移後、米長期金利上昇を支えに上昇し、147.56レベルでNYオープン。朝方には複数の米経済指標結果が発表され、米失業保険継続受給者数は予想より悪化、米10月個人支出と米10月PCEコアデフレーターでは共に伸びが鈍化している等の内容を受け、147.21まで売られる。その後、デイトリー・サンフランシスコ連銀総裁の「現在利下げは全く考えていない」、ウィリアムズ・ニューヨーク連銀総裁の「インフレが続けば、追加引き締めが必要になる公算」等の発言を受け、米金利上昇と月末絡みのドル買いフローが相まって、148.52まで続伸する。買い一巡後は、ロンドンフィクシングに掛けて、一転ドル売りが優勢となり、147.72まで反落。午後は米金利の高止まる展開に再び148.20付近まで戻す。その後、次第に動意乏しくなり、148.21レベルでクローズ。一方、海外市場のユーロドルは1.09台後半でスタート。独金利低下や、ユーロ圏11月CPIが予想より減速している結果を背景に、ユーロドルは軟調な展開が続き、1.0926レベルでNYオープン。朝方は米金利が上昇する展開が重しとなり、1.09台を割り込み、1.0888まで値を下げる。午後ともユーロ安の流れが続き、終盤に掛けては1.0879まで続落し、1.0889レベルでクローズ。

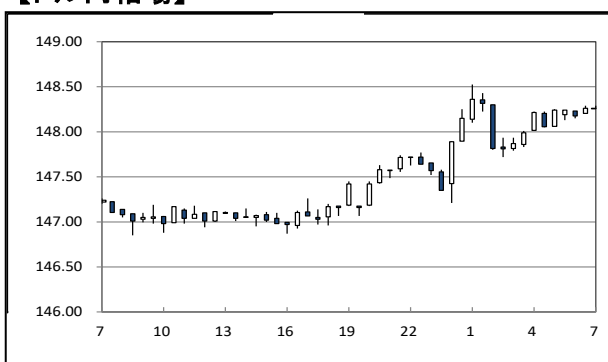
【昨日の指標等】

Date	Time	Event	結果	予想
11月30日	10:30	中 製造業PMI	11月 49.4	49.8
	10:30	中 非製造業PMI	11月 50.2	50.9
	19:00	欧 CPI速報値(前月比/前年比)	11月 -0.5%/2.4%	-0.2%/2.7%
	19:00	欧 CPIコア速報値	10月 3.6%	3.9%
	19:00	欧 失業率	10月 6.5%	6.5%
	22:30	米 新規失業保険申請件数	25-Nov 218K	218K
	22:30	米 PCEコアデフレーター(前月比/前年比)	10月 0.2%/3.5%	0.2%/3.5%
12月1日	00:00	米 中古住宅販売仮契約(前月比)	10月 -1.5%	-2.0%

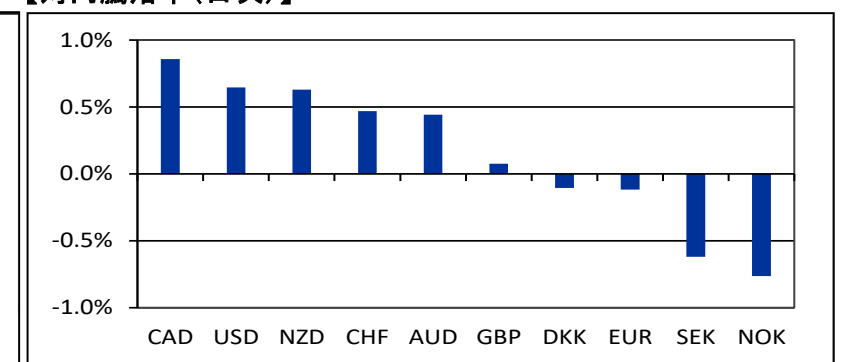
【本日の予定】

Date	Time	Event	予想	前回
12月1日	10:45	中 Caixin中国製造業PMI	11月 49.6	49.5
12月2日	00:00	米 建設支出(前月比)	10月 0.3%	0.4%
	00:00	米 ISM製造業景況指数	11月 47.8	46.7
	01:00	米 パウエル議長 講演	-	-

【ドル円相場】



【対円騰落率(日次)】



【予想レンジ】

通貨ペア	USD/JPY	EUR/USD	EUR/JPY
想定レンジ	147.50-149.50	1.0800-1.0950	160.80-162.00

【マーケット・インプレッション】

昨日のドル円は上昇。東京時間は147円を挟んだもみ合い推移となったがロンドン時間に入り徐々に上昇、NY時間朝方に発表された経済指標（米新規失業保険申請件数、米10月PCE）はほぼ市場予想通りであったが、デイトリー・SF連銀総裁の発言を受けて米金利が上昇するのに連れてドル円は148円を上抜け、148.20近傍でクローズ。本日は米11月ISM製造業景況指数の発表があるが、土曜日に行われるパウエルFRB議長の講演を意識した値動きとなるだろう。11月に大きく低下した米金利の一服感が見られる中、市場の利下げ折込みを修正する動きとなりドル円も上昇する展開を予想する。

当資料は情報提供のみを目的として作成したものであり、特定の取引の勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると判断した情報に基づいて作成されていますが、その正確性、確実性を保証するものではありません。ここに記載された内容は事前連絡なしに変更されることもあります。投資に関する最終決定は、お客様ご自身の判断でなさるようお願い申し上げます。また、当資料の著作権はみずほ銀行に属し、その目的を問わず無断で引用または複製することを禁じます。なお、当行は本情報を無償でのみ提供しております。当行からの無償の情報提供を望まれない場合、配信停止を希望する旨をお申し出ください。

担当: 中山・鈴木