

みずほCustomer Desk Report 2023/07/28 号(As of 2023/07/27)

市場営業部 為替営業第二チーム

【昨日の市況概要】				公示仲値	
	USD/JPY	EUR/USD	EUR/JPY	GBP/USD	AUD/USD
TKY 9:00AM	140.37	1.1078	155.48	1.2927	0.6761
SYD-NY High	141.30	1.1149	156.24	1.2995	0.6821
SYD-NY Low	138.77	1.0966	152.19	1.2782	0.6699
NY 5:00 PM	139.50	1.0976	153.14	1.2795	0.6709

	終値	(前日比)		終値	(前日比)
NY DOW	35,282.72	▲ 237.40	日本2年債	▲ 0.0400%	0.0000%
NASDAQ	14,050.11	▲ 77.17	日本10年債	0.4400%	0.0000%
S&P	4,537.41	▲ 29.34	米国2年債	4.9243%	0.0758%
日経平均	32,891.16	222.82	米国5年債	4.2344%	0.1199%
TOPIX	2,295.14	12.05	米国10年債	4.0012%	0.1295%
シカゴ日経先物	32,560.00	▲ 15.00	独10年債	2.4325%	▲ 0.0200%
ロンドンFT	7,692.76	15.87	英10年債	4.3045%	0.0300%
DAX	16,406.03	274.57	豪10年債	3.9490%	▲ 0.0450%
ハンセン指数	19,639.11	273.97	USDJPY 1M Vol	12.24%	0.78%
上海総合	3,216.67	▲ 6.36	USDJPY 3M Vol	10.65%	0.44%
NY金	1,945.70	▲ 24.40	USDJPY 6M Vol	9.92%	0.17%
WTI	80.09	1.31	USDJPY 1M 25RR	▲ 1.98%	Yen Call Over
CRB指数	280.17	▲ 0.70	EURJPY 3M Vol	10.64%	0.56%
ドルインデックス	101.77	0.89	EURJPY 6M Vol	10.06%	0.30%

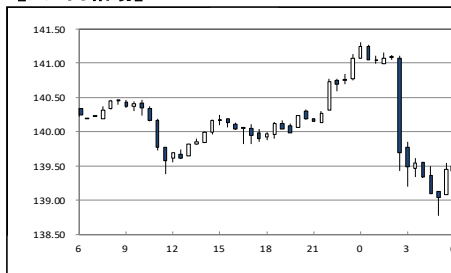
【昨日の指標等】

Date	Time	Event	結果	予想
7月27日	21:15	欧	ECB主要政策金利	27-Jul 4.3% 4.3%
	21:15	欧	ECB預金ファシリティ・レート	27-Jul 3.8% 3.8%
	21:30	米	GDP(年率/前期比)	2Q A 2.4% 1.8%
	21:30	米	個人消費	2Q A 1.6% 1.2%
	21:30	米	耐久財受注 前月比・速報 / 除輸送用機器	6月 4.7%/0.6% 1.3%/0.1%
	21:30	米	新規失業保険申請件数	22-Jul 221000 235000
	21:30	米	卸売在庫(前月比)・速報	6月 -0.3% -0.1%
	23:00	米	中古住宅販売仮契約(前月比)	6月 0.3% -0.5%
			ラガルドECB総裁会見	「データに依存する段階に移行」

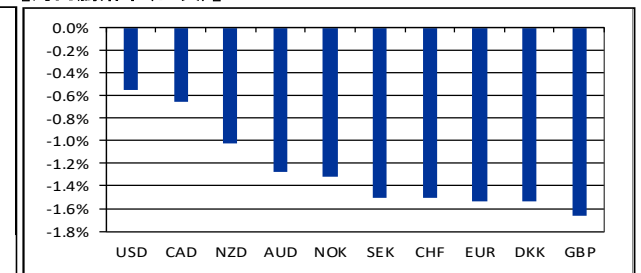
【本日の予定】

Date	Time	Event	予想	前回
7月28日	-	日	日銀金融政策決定会合	-
	08:30	日	東京CPI / コア	7月 2.9%/2.9% 3.2%/3.2%
	10:30	豪	PPI 前年比 / 前期比	2Q - 5.2%/1%
	10:30	豪	小売売上高(前月比)	6月 0.0% 0.7%
	18:00	欧	消費者信頼感・確報	7月 - -15.1
	18:00	欧	サービス業信頼感指数	7月 5.4 5.7
	21:00	独	CPI速報 前月比 / 前年比	7月 0.3%/6.2% 0.3%/6.4%
	21:30	米	PCEデフレータ 前月比 / 前年比	6月 0.2%/3% 0.1%/3.8%
	23:00	米	ミシガン大学消費者マインド・確報	7月 72.6 72.6

【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	138.50-142.00	1.0900-1.1500	151.00-156.50

【マーケット・インプレッション】

日銀が今回会合でYCCの修正案を議論するとの報道から、昨日は急速な円高が進行。本日朝方には一時139円台を割り込んだ。6月の日銀会合において植田総裁がYCCの修正については「ある程度のサプライズはやむを得ない」との発言もあり、日銀の政策修正への警戒は高まる。本日のドル円は日銀会合の結果次第であるが、YCC修正案の議論に留まり、政策据え置きとなれば昨日の下げを取り戻す展開となりそう。140円台への回復をメインシナリオとして考える。本日は米PCEデフレータなど米国で注目される経済指標の公表も控える。堅調な内容となれば、日米の金融政策の乖離が再度意識され、一層の円安が進行する可能性には警戒したい。仮に昨夜の報道の通り、長期金利の上限は0.5%で据え置くものの、市場動向に応じて0.5%を一定程度超えることも容認となれば、円高で反応しようが、昨年12月のYCCの変動幅修正(修正後6円近い急速な円高が進行と比較すれば、政策修正のインパクトは大きくなく、円高進行の幅は限られよう。

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: 松永・田川