

みずほCustomer Desk Report 2023/08/01号(As of 2023/07/31)

金融市場部 為替営業第二チーム

【昨日の市況概要】				公示仲値	140.97
	USD/JPY	EUR/USD	EUR/JPY	GBP/USD	AUD/USD
TKY 9:00AM	140.75	1.1024	155.20	1.2853	0.6660
SYD-NY High	142.70	1.1046	157.26	1.2872	0.6740
SYD-NY Low	140.69	1.0994	155.12	1.2829	0.6650
NY 5:00 PM	142.27	1.0997	156.47	1.2835	0.6719
	終値	(前日比)		終値	(前日比)
NY DOW	35,559.53	100.24	日本2年債	0.0005%	0.0105%
NASDAQ	14,346.02	29.37	日本10年債	0.6000%	0.0600%
S&P	4,588.96	6.73	米国2年債	4.8839%	0.0001%
日経平均	33,172.22	412.99	米国5年債	4.1827%	0.0008%
TOPIX	2,322.56	31.95	米国10年債	3.9658%	0.0102%
シカゴ日経先物	33,295.00	165.00	独10年債	2.4620%	0.0070%
ロンドンFT	7,699.41	5.14	英10年債	4.3035%	▲0.0190%
DAX	16,446.83	▲22.92	豪10年債	4.0320%	▲0.0670%
ハンセン指数	20,078.94	162.38	USDJPY 1M Vol	9.90%	0.15%
上海総合	3,291.04	15.11	USDJPY 3M Vol	9.68%	0.23%
NY金	2,009.20	48.80	USDJPY 6M Vol	9.28%	0.01%
WTI	81.80	1.22	USDJPY 1M 25RR	▲0.60%	Yen Call Over
CRB指数	282.18	1.69	EURJPY 3M Vol	9.55%	0.12%
ドルインデックス	101.86	0.23	EURJPY 6M Vol	9.38%	▲0.05%

東京	東京時間のドル円は140.75レベルでオープン。10時頃、日銀から臨時の国債買い入れオペの通告がなされると、円売りが強まり141円台を回復。底堅い日本株も横目に141.95まで上昇するも、節目142.00が意識され、小幅に下落し141.66レベルで海外に渡った。
ロンドン	ロンドン市場のドル円は、141.66レベルでオープン。特段の材料がない中、クロス円の上昇を背景に142.50まで買われ、結局、142.20レベルでNYに渡った。
ニューヨーク	海外市場のドル円は140円台後半でスタート。東京時間では、日銀による「残存期間5年超10年以下」を対象とした臨時の国債購入オペが行われた事を受け、円売りで反応し、141.60付近まで上昇する。その後も日米金利差を意識した円売りが続き、142.50まで続伸後、小幅反落し、142.20レベルでNYオープン。オープン序盤は142.70まで値を上げるも、その後発表された米7月MNIシカゴPMIが予想を下回ると、米金利が低下する展開も相まって、142.02まで反落する。午後は米第2四半期上級銀行貸出担当者調査が発表され、企業および消費者からの融資需要が減退しているとの内容が示されるも、影響薄。その後は142.20付近を挟んだ狭い値動きが続き、142.27レベルでクローズ。一方、海外市場のユーロドルは1.10台前半でスタート。1.1020を挟んだ方向感乏しい推移が続いたが、その後発表されたユーロ圏第2四半期GDPとコアCPI(前年比)が予想を上回ると、買いが先行し、1.1040まで上昇する場面も見られたが、その後失速し、1.1027レベルでNYオープン。朝方はドル売りが優勢となる中、1.1046まで戻すも、その後独金利低下が重しとなり、1.1010近辺まで反落する。午後ユーロ安の流れが続き、終盤には1.10台を割り込み、1.0997レベルでクローズ。

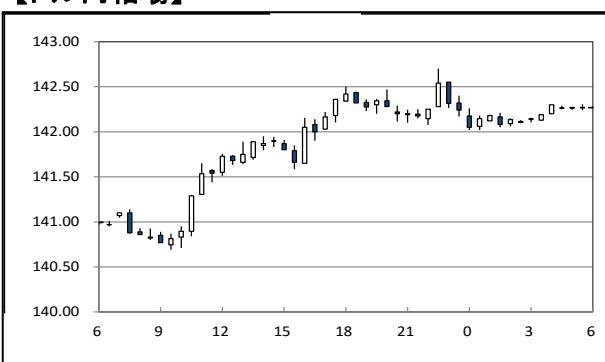
【昨日の指標等】

Date	Time	Event	結果	予想
7月31日	10:30	中 製造業PMI	7月 49.3	48.9
	10:30	中 非製造業PMI	7月 51.5	53.0
	15:00	独 小売売上高(前月比)	6月 -0.8%	-0.3%
	18:00	欧 GDP(前期比/前年比)	2Q A 0.3%/0.6%	0.2%/0.5%
	18:00	欧 CPI速報値(前月比/前年比)	7月 -0.1%/5.3%	-0.1%/5.3%
	18:00	欧 コアCPI・速報	7月 5.5%	5.4%
	22:45	米 MNIシカゴPMI	7月 42.8	43.5

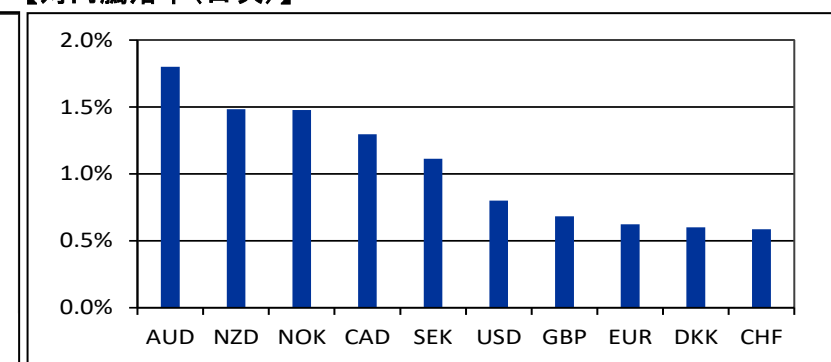
【本日の予定】

Date	Time	Event	予想	前回
8月1日	08:30	日 失業率	6月 2.6%	2.6%
	10:45	中 Caixin中国製造業PMI	7月 50.1	50.5
	13:30	豪 RBAキャッシュレート	1-Aug 4.35%	4.10%
	23:00	米 ISM製造業景況指数	7月 46.9	46.0

【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	141.50-143.50	1.0950-1.1150	156.00-157.50

【マーケットインプレッション】

先週金曜のドル/円は141.18でクローズ。昨日月曜は当初は前日比やや円高となる140円台後半での推移となり、YCC柔軟化の効果見極めムードかと思われたが、日本時間10時過ぎに日銀が臨時の国債買い入れオペを通告、オファー額3,000億円とのヘッドラインが出るとドル/円は急伸。142円手前で一旦は調整するも、欧州勢参入後は大台142円を難なく突破。北米市場入りするともう一段上値をトライし、142.70を示現した。

昨日は月末日で東京時間中は本邦実需からはドル買いが出て、ドル/円上昇の一因となった。ただ、海外時間に入って以降も上昇トレンドが継続した点、また日本株が前日比プラス圏で終わった点は冷静に受け止める必要があり、従前巷で言われていた「YCC調整後の相場予想」とは異なった展開となっている。今後の臨時オペを見ながらではあるが、円安トレンド継続を予想。6月末～今月初に見られたような145円を狙う展開も視野に入る。

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: 田川・松木