

みずほCustomer Desk Report 2023/08/03号 (As of 2023/08/02)

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	143.20
TKY 9:00AM	142.98	1.1008	157.37	GBP/USD	AUD/USD
SYD-NY High	143.46	1.1020	157.50	1.2778	0.6618
SYD-NY Low	142.24	1.0917	156.26	1.2805	0.6630
NY 5:00 PM	143.35	1.0939	156.81	1.2680	0.6528
	1.2712	0.6538			
	終値	(前日比)	終値	(前日比)	
NY DOW	35,282.52	▲ 348.16	日本2年債	0.0100%	0.0200%
NASDAQ	13,973.45	▲ 310.47	日本10年債	0.6200%	0.0300%
S&P	4,513.39	▲ 63.34	米国2年債	4.8841%	▲0.0207%
日経平均	32,707.69	▲ 768.89	米国5年債	4.2433%	0.0185%
TOPIX	2,301.76	▲ 35.60	米国10年債	4.0876%	0.0515%
ソコ日経先物	32,380.00	▲ 845.00	独10年債	2.5045%	▲0.0195%
ロンドンFT	7,561.63	▲ 104.64	英10年債	4.3965%	▲0.0020%
DAX	16,020.02	▲ 220.38	豪10年債	4.0310%	0.0190%
ハンセン指数	19,517.38	▲ 493.74	USDJPY 1M Vol	10.02%	0.14%
上海総合	3,261.69	▲ 29.26	USDJPY 3M Vol	9.94%	0.16%
NY金	1,975.00	▲ 3.80	USDJPY 6M Vol	9.62%	0.18%
WTI	79.49	▲ 1.88	USDJPY 1M 25RR	▲0.76%	Yen Call Over
CRB指数	276.50	▲ 4.35	EURJPY 3M Vol	9.79%	0.16%
ドルインデックス	102.59	0.29	EURJPY 6M Vol	9.67%	0.18%

東京	早朝の「格付会社が米国を格下げ」とのヘッドラインに143円台半ばから142円台前半まで下落後、徐々に値を戻す中、東京時間のドル円は142.98レベルでオープン。仲値にかけて強まった実需のドル買いの流れから、正午頃には一時143.35をつける。ただ上昇が一服すると、日経平均株価が下げ幅を拡大する中、リスクオフ寄りの動きが強まり142円台後半まで反落すると、142.80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、142.80レベルでオープン。米格付けの格下げを受けたリスクオフの円買いで142.24まで売られる。しかし午後後に米指標を控えてか、米株価先物が下げ止まるとリスクセンチメントがやや改善。結局ほぼ変わらずの142.80レベルでNYに渡った。
ニューヨーク	海外市場のドル円は143円台半ばでスタート。米格付け会社による米国債の格下げ報道や、日経平均株価の大幅安等が重しとなり、リスク回避の円買いが先行し、142.24まで下落する。円買い一巡後は、反発し142.80レベルでNYオープン。朝方に発表された米7月ADP雇用統計が予想を大幅に上回り、ドル買いが優勢となり、143.20付近まで上昇する。その後、米金利が高水準で推移する展開がサポートとなり、143.46まで続伸する。しかし、その後は伸び悩み、143.20台まで小幅反落する。午後は143.06まで下落する場面も見られたが、終盤に掛けて再び143.40台まで反発する。その後小幅反落し、143.35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。先述の米国債の格下げ報道を受け、1.1020まで上昇するも、その後独金利が低水準で推移する動きが下押し要因となり、じり安での推移が続き、1.0978レベルでNYオープン。朝方は米7月ADP雇用統計の内容を受け、ドルが買われる中、1.0917まで続落する。その後は下げ渋り、1.0940台まで値を戻す。午後は1.0957まで上げ幅を拡大するも、その後小幅反落し、1.0939レベルでクローズ。

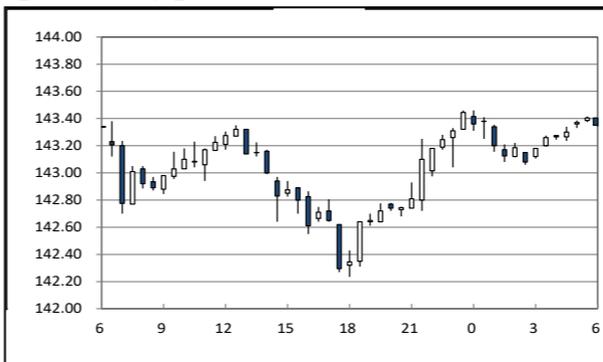
【昨日の指標等】

Date	Time	米	Event	結果	予想	
8月2日	21:15	米	ADP雇用統計	7月	324k	190k

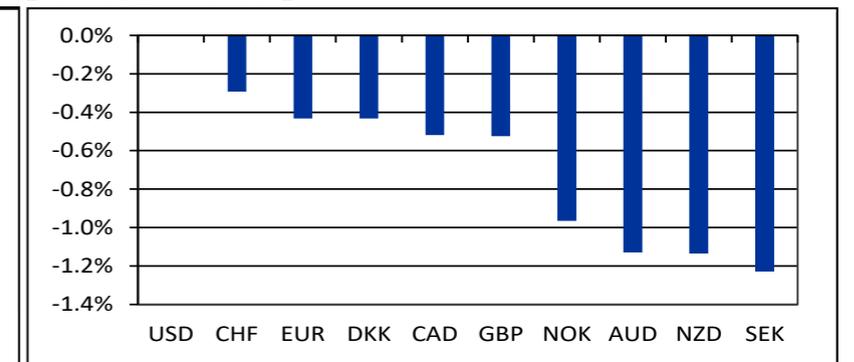
【本日の予定】

Date	Time	豪	Event	予想	前回	
8月3日	10:30	豪	貿易収支	6月	A\$10750m	A\$11791m
	10:45	中	Caixin中国PMIコンポジット	7月	-	52.5
	10:45	中	Caixin中国PMIサービス業	7月	52.4	53.9
	17:00	欧	サービス業PMI・確報	7月	51.1	51.1
	17:00	欧	コンポジットPMI・確報	7月	48.9	48.9
	18:00	欧	PPI(前月比/前年比)	6月	-0.3%/-3.2%	-1.9%/-1.5%
	20:00	英	イングランド銀行 政策金利	3-Aug	5.25%	5.00%
	21:30	米	バーキン・リッチモンド連銀総裁 講演	-	-	-
	21:30	米	新規失業保険申請件数	29-Jul	225k	221k
	23:00	米	製造業受注(前月比)	6月	2.3%	0.3%
	23:00	米	製造業受注(除輸送)	6月	0.1%	-0.5%
	23:00	米	ISM非製造業景況指数	7月	53.0	53.9

【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	142.50-144.00	1.0850-1.1000	155.80-157.80

【マーケット・インプレッション】

昨日は米債の格下げを受けリスクオフの展開。東京時間の序盤は実需の買いに支えられ143円台を推移したものの、日本株が下げ幅を拡大させる中、143円台を割り込むと海外時間入り後に142.24まで下落。円買いが一巡すると自立反発し、NY時間に発表されたADP雇用統計が強い結果となると143円台を回復。高値143.46をつけた後も米金利の底堅さを横目に143円台前半での推移が継続した。先週、中銀イベントを消化したが、結局、インフレ抑制のためにタカ派スタンスを維持する米国と、緩和政策を維持する日本の構図は変わらず。米債の格下げによって株式市場が全般的に下落する中でもリスクオフの円買いは継続せず、高止まりする米金利にサポートされドル円は底堅く推移。本日も格下げの余波を見極めつつも基本的には昨日の流れを引き継いで、ドル円は底堅い推移を想定。足許、米経済のリセッションリスクが後退し、指標結果もその見方を後押しする中、本日のISM非製造業や週末の雇用統計の結果が冴えなかった場合のドル円の下落リスクが増大している点には警戒したい。

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: 逸見・西