

みずほCustomer Desk Report 2024/01/18号 (As of 2024/01/17)

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	147.44
TKY 9:00AM	147.24	1.0878	160.24	GBP/USD	AUD/USD
SYD-NY High	148.52	1.0884	161.28	1.2640	0.6589
SYD-NY Low	147.09	1.0845	160.02	1.2696	0.6594
NY 5:00 PM	148.15	1.0883	161.28	1.2597	0.6525
	終値	(前日比)		終値	(前日比)
NY DOW	37,266.67	▲ 94.45	日本2年債	0.0200%	0.0100%
NASDAQ	14,855.62	▲ 88.73	日本10年債	0.6100%	0.0200%
S&P	4,739.21	▲ 26.77	米国2年債	4.3587%	0.1392%
日経平均	35,477.75	▲ 141.43	米国5年債	4.0289%	0.0962%
TOPIX	2,496.38	▲ 7.60	米国10年債	4.1048%	0.0514%
ソコ日経先物	35,535.00	▲ 370.00	独10年債	2.2730%	0.0585%
ロンドンFT	7,446.29	▲ 112.05	英10年債	3.9790%	0.1820%
DAX	16,431.69	▲ 139.99	豪10年債	4.2040%	0.0380%
ハンセン指数	15,276.90	▲ 589.02	USDJPY 1M Vol	9.72%	0.18%
上海総合	2,833.62	▲ 60.37	USDJPY 3M Vol	9.66%	0.22%
NY金	2,006.50	▲ 23.70	USDJPY 6M Vol	9.73%	0.23%
WTI	72.56	0.16	USDJPY 1M 25RR	▲0.98%	Yen Call Over
CRB指数	263.05	▲ 1.25	EURJPY 3M Vol	9.21%	0.19%
ドルインデックス	103.45	0.09	EURJPY 6M Vol	9.45%	0.15%

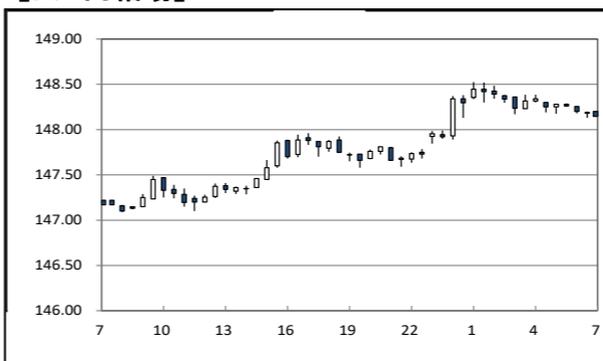
【昨日の指標等】

Date	Time	Event	結果	予想
1月17日	11:00	中 GDP(前年比)	4Q 5.2%	5.3%
	11:00	中 鉱工業生産(前年比)	12月 6.8%	6.6%
	11:00	中 小売売上高(前年比)	12月 7.4%	8.0%
	16:00	英 CPI(前月比/前年比)	12月 0.4%/4.0%	0.2%/3.8%
	16:00	英 CPIコア(前年比)	12月 5.1%	4.9%
	19:00	欧 CPI(前年比/前月比)・確報	12月 2.9%/0.2%	2.9%/0.2%
	22:30	米 小売売上高速報(前月比)	12月 0.6%	0.4%
	22:30	米 小売売上高(除自動車/前月比)	12月 0.4%	0.2%
	23:15	米 鉱工業生産(前月比)	12月 0.1%	-0.1%

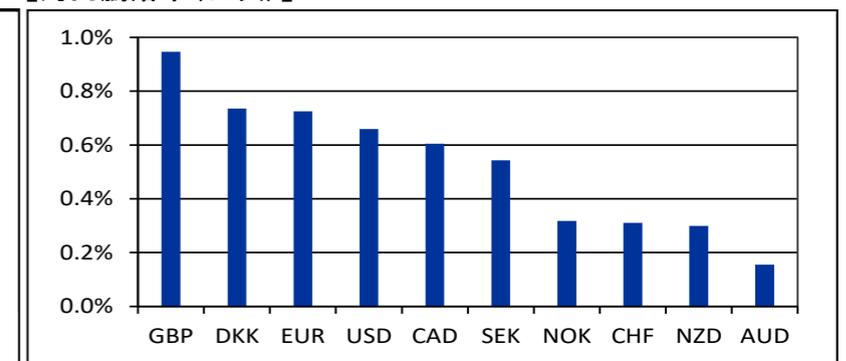
【本日の予定】

Date	Time	Event	予想	前回
1月18日	09:30	豪 雇用者数変化/失業率	12月 15.0k/3.9%	61.5k/3.9%
	21:30	欧 ECB議事要旨	-	-
	22:30	米 住宅着工件数	12月 1425k	1560k
	22:30	米 建設許可件数	12月 1476k	1467k
	22:30	米 フィラデルフィア連銀景況	1月 -6.7	-12.8
	22:30	米 新規失業保険申請件数	13-Jan 205k	202k

【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	147.00-149.00	1.0800-1.0930	160.00-161.50

【マーケット・インプレッション】

東京時間は日経平均がバブル後高値をつけるも、その後中国指標を切欠に反転。リスクオフのドル買い主導でドル円は上昇が継続。海外時間、米12月小売売上高が予想を上回る結果に米利下げ織込が後退、素直に米金利上昇につれて一時148.52まで上昇も、米雇用統計後の米10Y4.1%レベルを明確に抜けられず、ドル円は148.20レベルまで戻してクローズ。本日は中国大幅株安なども影響し、一本調子で上昇してきた日本株にも調整が入りやすいか。ドル円は148円台では輸出の売りも相応に入ることが予想されること、米金利がもう一段上昇するには来週のPCEまで待たなければならないことを踏まえれば、一旦ドル円の調整をみたいところ。来週の日銀金融決定会合では政策変更は予想されていないものの、足元の株高、円安、賃上げ動向を踏まえて、声明文や展望レポートで市場の織込みを牽制してくる可能性にも注意。ただ、実質的に円買い材料はなく、特段動きがなければドル円の下値は堅い。

東京	東京時間のドル円は147.24レベルでオープン。朝方はじり安の展開で11時過ぎにつけた147.10が東京安値に。その後は反転し、徐々に下値を切り上げる展開。14時半過ぎからは147.50のストップロス巻き込んで一段水準を切り上げ、米金利上昇も相まって147.88を示現。その後147.86レベルで欧州へ渡った。
ロンドン	ロンドン市場のドル円は、147.86レベルでオープン。全般にドルが強かったが、欧州株が下落するリスクオフの展開で、ドル円は方向感なし。147.75レベルでNYに渡った。ポンドドルは、1.2600レベルでオープン。朝方発表された英12月CPIが予想を上回る伸びとなったことでポンドは堅調。1.2696まで買われ1.2675レベルでNYに渡った。
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。前日の米早期利下げ観測が後退した事を背景に、米金利における一段の上昇を横目にドル円は底堅く推移し、147.75レベルでNYオープン。朝方に発表された米12月小売売上高とコア小売売上高が共に予想を上回った事や、米12月鉱工業生産も予想より強い結果となった事から、ドル買いが優勢となり、年初来高値の148.52まで上伸。午後は米長期金利低下が上値を抑え、148.17まで反落する。その後はページブックの発表もあったが、特段驚くような内容も見当たらず、148.20近辺を中心とした膠着感強い値動きが続き、148.15レベルでクローズ。一方、海外市場のユーロドルは1.08台後半でスタート。1.0856まで下落する場面も見られたが、ラガルドECB総裁が「インフレ率はECBが望んでいる水準にない」との発言を受け、買いが優勢となり、1.0875レベルでNYオープン。朝方は強い米経済指標の結果を受け、ドル買いが強まり1.0845まで反落。午後は米長期金利が落ち着く展開を背景に反発し、1.0883まで戻し同レベルでクローズした。

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: 伊藤(拓)・松木