

みずほCustomer Desk Report 2024/01/29 号 (As of 2024/01/26)

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	147.65 AUD/USD
TKY 9:00AM	147.73	1.0846	160.22	1.2706	0.6582
SYD-NY High	148.21	1.0885	160.93	1.2758	0.6609
SYD-NY Low	147.41	1.0813	159.88	1.2677	0.6575
NY 5:00 PM	148.13	1.0855	160.78	1.2703	0.6575

	終値	(前日比)		終値	(前日比)
NY DOW	38,109.43	60.30	日本2年債	0.0400%	▲0.0200%
NASDAQ	15,455.36	▲ 55.13	日本10年債	0.7100%	▲0.0400%
S&P	4,890.97	▲ 3.19	米国2年債	4.3551%	0.0567%
日経平均	35,751.07	▲ 485.40	米国5年債	4.0375%	0.0366%
TOPIX	2,497.65	▲ 34.27	米国10年債	4.1383%	0.0190%
シカゴ日経先物	35,945.00	▲ 130.00	独10年債	2.2960%	0.0140%
ロンドンFT	7,635.09	105.36	英10年債	3.9655%	▲0.0170%
DAX	16,961.39	54.47	豪10年債	-	-
ハンセン指数	15,952.23	▲ 259.73	USDJPY 1M Vol	8.19%	▲0.19%
上海総合	2,910.22	4.11	USDJPY 3M Vol	9.03%	▲0.08%
NY金	2,017.30	▲ 0.50	USDJPY 6M Vol	9.35%	▲0.09%
WTI	78.01	0.65	USDJPY 1M 25RR	▲1.06%	Yen Call Over
CRB指数	273.57	1.17	EURJPY 3M Vol	8.62%	▲0.06%
ドルインデックス	103.43	▲ 0.14	EURJPY 6M Vol	9.17%	▲0.05%

東京	東京時間ドル/円は147.73レベルでオープン。朝方はCPIを見て堅調推移し、東京高値となる147.85まで上伸。ただ、コアコアは3%を維持しており、ドル/円の上昇は続かず147.60を挟んでの展開へ。11時頃につけた147.48が安値に。午後に入ると下値を切り上げていく展開で、147.80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、147.80レベルでオープン。立ち上がり米金利が上昇したこともありドル買いで始まり148.09まで上昇。しかし特段の材料がない中、米金利が下落すると全般にドル売りの展開に。147.60まで売られ結局ほぼ変わらずの147.78レベルでNYに渡った。欧州株はラグジュアリーセクターが牽引する形でリスクオンだった。
ニューヨーク	海外市場のドル円は147円台半ばでスタート。本邦1月CPIが予想を下回った事や、米金利が上昇する展開を背景に、148.09まで上昇。しかし、その後は米金利が低下する動きが重しとなり、147.78レベルでNYオープン。朝方に発表された米12月個人支出や、米12月PCEコアデフレーター(前月比)が前回の結果を上回った結果を受け、148.20手前まで買われる。しかし、その後は伸び悩み、147.90付近まで反落。午後は低下していた米長期金利が戻す展開に再び買いで反応し、148.21まで反発。その後徐々に小動きとなり、148.13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。独2月GfK消費者信頼感指数が予想より悪化し、独金利低下に伴い、1.0813まで下落。しかし、その後欧州株高や、独金利が上昇する展開が支援材料となり、ユーロの買戻しが入り、1.0868レベルでNYオープン。朝方は1.0885まで上伸するも、その後米金利が上昇する展開に上値を抑えられ、1.0860近辺まで反落。午後は1.0860近辺を中心とした動意乏しい推移が続き、1.0855レベルでクローズ。

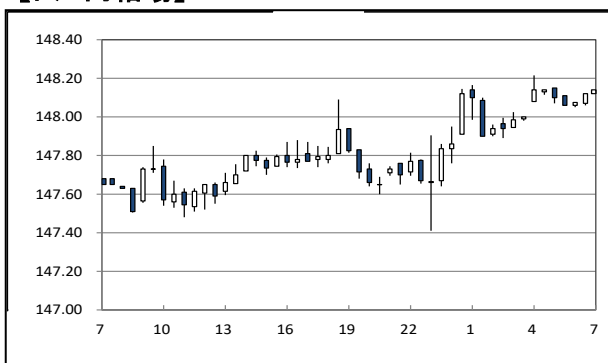
【昨日の指標等】

Date	Time	Event	結果	予想
1月26日	08:30	日 東京CPI	1月 1.6%	2.0%
1月26日	08:30	日 東京コアCPI	1月 1.6%	1.9%
1月26日	14:00	日 景気一致指数・確報	11月 114.6	-
1月26日	22:30	米 PCEデフレーター(前月比/前年比)	12月 0.2%/2.6%	0.2%/2.6%
1月27日	00:00	米 中古住宅販売仮契約(前月比)	12月 8.3%	2.0%

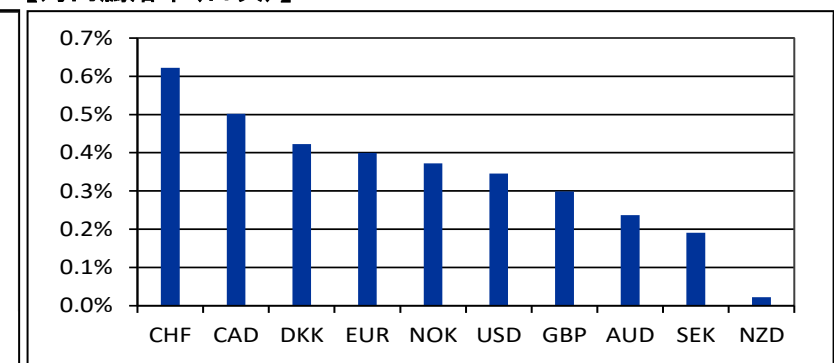
【本日の予定】

Date	Time	Event	予想	前回

【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	147.50-148.80	1.0800-1.0900	160.00-161.50

【マーケット・インプレッション】

先週金曜日に発表された米経済指標では12月個人所得ならびにPCEデフレーターは市場予想通りの結果となるも、個人支出は市場予想を上回った。米国のインフレは鈍化傾向にありながら、個人消費は引き続き堅調であることが確認できる結果となった。今週は30-31日で米国連邦公開市場委員会(FOMC)の政策決定が行われる。事前にFOMC参加者から早期の利下げ開始を否定する発言が繰り返されており、さらに先週発表された米経済指標からもFRBとしては利下げを急ぐ必要はないとみている。FOMCの結果が出るまで為替相場は方向感が出にくいと予想しているが、利下げ観測が後退するとドルはジリジリと買い戻される展開を予想。ただし、本日は月末のスポット応答日となることからフロー主導での値動きとなろう。月末のフローをこなした後は、FOMCを控え様子見モードが強まるだろう。

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: 山口・南野