

みずほCustomer Desk Report 2024/02/02 号(As of 2024/02/01)

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 | GBP/USD | AUD/USD | 公示値 | 146.84 |
|-------------|-----------|----------|----------------|---------|---------------|-----|--------|
| TKY 9:00AM | 147.01 | 1.0803 | 158.81 | 1.2680 | 0.6563 | | |
| SYD-NY High | 147.10 | 1.0874 | 159.21 | 1.2755 | 0.6579 | | |
| SYD-NY Low | 145.90 | 1.0780 | 158.11 | 1.2625 | 0.6508 | | |
| NY 5:00 PM | 146.41 | 1.0872 | 159.21 | 1.2743 | 0.6572 | | |
| | 終値 | (前日比) | | 終値 | (前日比) | | |
| NY DOW | 38,519.84 | 369.54 | 日本2年債 | 0.0800% | ▲0.0100% | | |
| NASDAQ | 15,361.64 | 197.63 | 日本10年債 | 0.6900% | ▲0.0400% | | |
| S&P | 4,906.19 | 60.54 | 米国2年債 | 4.2087% | 0.0020% | | |
| 日経平均 | 36,011.46 | ▲ 275.25 | 米国5年債 | 3.8163% | ▲0.0217% | | |
| TOPIX | 2,534.04 | ▲ 17.06 | 米国10年債 | 3.8812% | ▲0.0359% | | |
| シカゴ日経先物 | 36,150.00 | 245.00 | 独10年債 | 2.1380% | ▲0.0215% | | |
| ロンドンFT | 7,622.16 | ▲ 8.41 | 英10年債 | 3.7445% | ▲0.0490% | | |
| DAX | 16,859.04 | ▲ 44.72 | 豪10年債 | 4.0180% | ▲0.0560% | | |
| ハンセン指数 | 15,566.21 | 81.14 | USDJPY 1M Vol | 9.03% | 0.19% | | |
| 上海総合 | 2,770.74 | ▲ 17.81 | USDJPY 3M Vol | 9.71% | 0.10% | | |
| NY金 | 2,071.10 | 3.70 | USDJPY 6M Vol | 9.61% | 0.06% | | |
| WTI | 73.82 | ▲ 2.03 | USDJPY 1M 25RR | ▲1.32% | Yen Call Over | | |
| CRB指数 | 269.71 | ▲ 2.70 | EURJPY 3M Vol | 9.42% | 0.05% | | |
| ドルインデックス | 103.05 | ▲ 0.23 | EURJPY 6M Vol | 9.52% | 0.01% | | |

| | |
|--------|---|
| 東京 | 東京時間のドル円は147.01レベルでオープン。午前中は前日米国時間の米国地銀をめぐる懸念が意識され、TOPIXでは銀行株がアンダーパフォームすると共にドル円は下落し一時146.48を付けた。午後にかけてはTOPIX銀行株とともにドル円も値を戻し、結局146.91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、146.91レベルでオープン。イベント通過後にやや方向感の定まらない展開でもみ合った後、146.97レベルでNYに渡った。ポンド円は、1.2667レベルでオープン。正午に英中銀政策決定を控え朝方は1.2625まで下落。英中銀が予想通り政策金利を5.25%に据置く一方で利上げに票を入れた委員がいたことが報じられるとポンド円は1.2685まで買い戻され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146円台後半でスタート。日本株安の展開を受け、リスクオフの円買いが進み、146.48まで下落。その後は低下していた米長期金利が上昇する展開に買い戻しが入り、146.97レベルでNYオープン。朝方には複数の米経済指標が発表され、米第4四半期単位人件費、米新規失業保険申請件数と失業保険継続受給者数が総じて予想より悪化し、米金利が低下する中、ドル円も146.30付近まで下落。続いて発表された米1月ISM製造業景況指数ヘッドラインは予想を上回り、一時146.80近辺まで買い戻されるも、構成項目の雇用部分が前回より低下している事が嫌気されてか、その後145.90まで反落。午後は米金利が戻す展開がサポートとなり、146.30付近を中心とした推移が続き、146.41レベルでクローズ。一方、海外市場のユーロ円は1.08台前半でスタート。米長期金利が上昇する展開が重しとなり、1.0780まで下落。しかし、続いて発表されたユーロ圏1月コアCPI(前年比)が予想以上の伸びを見せた結果を受け、買いが優勢となり、1.0816レベルでNYオープン。午前中は米金利が低下する展開を眺めがら、ユーロ円は底堅い値動きを見せ、1.0866まで上伸。午後もユーロ高の流れが続き、終盤にかけては1.0874まで値を上げ、その後1.0872レベルでクローズ。 |

【昨日の指標等】

| Date | Time | Event | 結果 | 予想 |
|------|-------|-------------------|---------------|------------|
| 2月1日 | 10:45 | 中 Caixin中国製造業PMI | 1月 50.8 | 50.8 |
| | 19:00 | 欧 CPI(前月比/前年比)・速報 | 1月 -0.4%/2.8% | -0.4%/2.7% |
| | 19:00 | 欧 CPIコア(前年比) | 1月 3.3% | 3.2% |
| | 19:00 | 欧 失業率 | 12月 6.4% | 6.4% |
| | 20:30 | 欧 レーン・ECB理事 講演 | - インフレ2%の確信必要 | |
| | 21:00 | 英 イングランド・銀行政策金利 | 1-Feb 5.25% | 5.25% |
| | 22:30 | 米 新規失業保険申請件数 | 27-Jan 224k | 212k |
| | 00:00 | 米 ISM製造業景況指数 | 1月 49.1 | 47.2 |

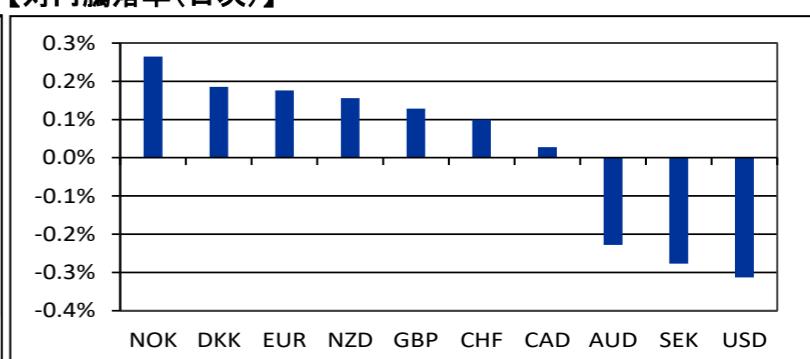
【本日の予定】

| Date | Time | Event | 予想 | 前回 |
|------|-------|---------------------|---------------|-----------|
| 2月2日 | 22:30 | 米 非農業部門雇用者数変化 | 1月 185k | 216k |
| | 22:30 | 米 失業率 | 1月 3.8% | 3.7% |
| | 22:30 | 米 平均時給(前月比/前年比) | 1月 0.3%/4.1% | 0.4%/4.1% |
| | 00:00 | 米 ミシガン大学消費者マインド・確報 | 1月 78.9 | 78.8 |
| 2月3日 | 00:00 | 米 製造業受注(前月比/除輸送) | 12月 0.2%/0.2% | 2.6%/0.1% |
| | 00:00 | 米 耐久財受注(前月比/除輸送)・確報 | 12月 0.0%/0.6% | 0.0%/0.6% |

【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 | 144.80-147.50 | 1.0750-1.0950 | 158.00-160.00 |

【マーケット・インプレッション】

昨日のドル円は、米国雇用関連指標の結果を受けドル安が進行。その後公表された米1月ISM製造業景況指数は市場予想を上回ったが、ドルの軟調な地合いは継続し、米金利の低下とともに、一時145.90まで下落した。先月末のFOMC会合を受け3月会合での利下げへの市場の織り込みは低下したものの、引き続き今後の政策運営は経済指標次第とのスタンスを継続する中、経済指標の結果にドル円が大きく反応する地合いが続く。本日は米雇用統計の公表を控える。市場の事前予想は先月実績からの悪化を見込むが、予想通りの結果となり米労働市場の緩和が確認されれば、ドル安方向へ相場が大きく反応する可能性もあり警戒したい。

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があります。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: 松永・升谷