ともに挑む。ともに実る。
MIZUHO みずほ銀行

みずほCustomer Desk Report 2024/08/06 号(As of 2024/08/05)

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
				公示仲値	145.39
TKY 9:00AM	145.59	1.0910	158.90	1.2787	0.6498
SYD-NY High	146.55	1.1009	159.81	1.2817	0.6520
SYD-NY Low	141.68	1.0894	154.44	1.2710	0.6349
NY 5:00 PM	144.23	1.0952	157.91	1.2778	0.6497

	終値	(前日比)		終値	(前日比)
NY DOW	38,703.27	▲ 1,033.99	日本2年債	0.2625%	▲0.1475%
NASDAQ	16,200.08	▲ 576.08	日本10年債	0.7690%	▲0.1810%
S&P	5,186.33	▲ 160.23	米国2年債	3.8986%	0.0271%
日経平均	31,458.42	▲ 4,451.28	米国5年債	3.6233%	0.0092%
TOPIX	2,227.15	▲ 310.45	米国10年債	3.7781%	▲0.0133%
ｼｶｺﾞ日経先物	33,320.00	▲ 1,700.00	独10年債	2.1815%	0.0215%
ﾛﾝﾄﾞﾝFT	8,008.23	▲ 166.48	英10年債	3.8640%	0.0305%
DAX	17,339.00	▲ 322.22	豪10年債	3.8500%	▲0.1940%
ﾊﾝｾﾝ指数	16,698.36	▲ 247.15	USDJPY 1M Vol	15.50%	3.60%
上海総合	2,860.70	▲ 44.64	USDJPY 3M Vol	12.43%	1.58%
NY金	2,444.40	▲ 25.40	USDJPY 6M Vol	11.01%	0.71%
WTI	72.94	▲ 0.58	USDJPY 1M 25RR	▲3.79%	Yen Call Over
CRB指数	268.79	▲ 1.34	EURJPY 3M Vol	12.08%	1.67%
ドルインデックス	102.69	▲ 0.52	EURJPY 6M Vol	10.85%	0.90%

【昨日の指標等】

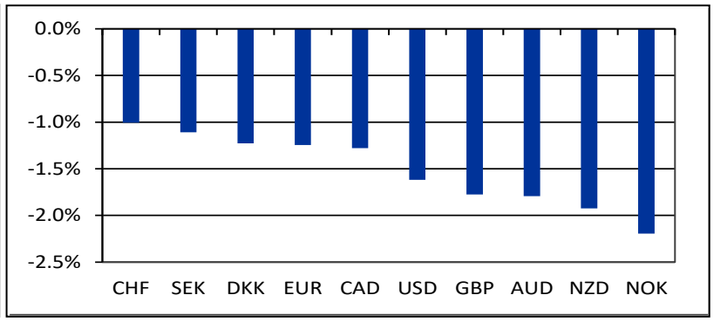
Date	Time		Event		結果	予想
8月5日	10:45	中	Caixin中国PMIサービス業/コンポジット	7月	52.1/51.2	51.5/-
	18:00	欧	PPI(前月比/前年比)	6月	0.5%/-3.2%	0.5%/-3.3%
	21:30	米	グールズビー・シカゴ連銀総裁講演	「リセッションの様相はまだ呈していない」		
	22:45	米	ｻｰﾋﾞｽ業/コンポジットPMI 確報	7月	55.0/54.3	56.0/-
	23:00	米	ISM非製造業景況指数	7月	51.4	51.0

【本日の予定】

Date	Time		Event		予想	前回
8月6日	13:30	豪	RBAｷｬｯｼｭﾚｰﾄ	6-Aug	4.35%	4.35%
	15:00	独	製造業受注(前月比)	6月	0.5%	-1.6%
	18:00	欧	小売売上高(前月比/前年比)	6月	-0.1%/0.1%	0.1%/0.3%
	21:30	米	貿易収支	6月	-$72.5b	-$75.1b

【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	144.30-146.50	1.0890-1.1000	158.20-159.90

東京	東京時間のﾄﾞﾙ円は145.59ﾚﾍﾞﾙでｵｰﾌﾟﾝ。先週末に発表された米7月雇用統計の軟調な結果を受けたｸﾞﾛｰﾊﾞﾙな景気後退懸念もあり、日本株が大幅下落する展開にﾄﾞﾙ円も終始売り優勢となった。正午には中東の地政学ﾘｽｸ高まりに、一段と日本株が下落幅を拡大させるとﾄﾞﾙ円も143円台割れまで急落。その後は141.68まで下値を拡大したのち、142.60ﾚﾍﾞﾙで海外時間に渡った。
ロンドン	ﾛﾝﾄﾞﾝ時間のﾄﾞﾙ円は142.60ﾚﾍﾞﾙでｵｰﾌﾟﾝ。世界的な株安でﾘｽｸｵﾌﾑｰﾄﾞ。いわゆる恐怖指数も20年のﾊﾟﾝﾃﾞﾐｯｸ時以来の水準まで上昇した。ﾄﾞﾙも全般に売られ、ﾄﾞﾙ円は141.75まで下落するもその後はもみ合い、結局142.29ﾚﾍﾞﾙでNYへ渡った。
ニューヨーク	日経平均株価が史上最大の下げ幅を記録する中、円買いが優勢となり、ﾄﾞﾙ円は141.68まで下落する。その後は下げ渋り、小幅反発し、142.29ﾚﾍﾞﾙでNYｵｰﾌﾟﾝ。朝方は低下していた米金利が上昇する展開に追随し、143円台ちょうど付近まで戻す。続いて発表された米7月ISM非製造業景況指数が予想を上回ると、ﾄﾞﾙの買戻しが優勢となり、144.88まで上伸。午後に発表された米第2四半期融資担当者調査では、商業用不動産に対する需要が低迷である事が示され、米金利が一段と低下する動きを横目にﾄﾞﾙ円も伸び悩み、143.40付近まで反落。その後は再び買い戻され、144円台を回復し、144.23ﾚﾍﾞﾙでｸﾛｰｽﾞ。 一方、海外市場のﾕｰﾛﾄﾞﾙは1.09台前半でｽﾀｰﾄ。1.0975まで上昇する場面もあったが、その後に発表されたﾕｰﾛ圏8月ｾﾝﾃｨｯｸｽ投資家信頼感指数が予想以上に悪化した事が上値を抑え、1.0963ﾚﾍﾞﾙでNYｵｰﾌﾟﾝ。午前中は米金利の低下が支えとなり、1.10台を突破し、1.1009まで上値を伸ばす。しかし続いて発表された米7月ISM非製造業景況指数が予想を上回った事を受け、ﾄﾞﾙが買い戻される中、1.0960付近まで反落。午後は1.0950付近でほぼ横ばいで推移し、1.0952ﾚﾍﾞﾙでｸﾛｰｽﾞ。

【マーケット・インプレッション】

昨日のドル円は水準を切り下げる展開。日本時間には、日本株が大幅下落する展開や中東の地政学リスク高まりに、円買いで反応し一時141.68まで下落。その後、米国時間に発表された米7月ISM非製造業景況指数が予想を上回ると、ドルの買戻しが優勢となり、144円台を回復しクローズ。
本日のドル円は底堅い展開を予想。昨日発表された米7月ISM非製造業景況指数では市場予想よりも上振れ、米景気減速の懸念を弱める結果となった。下落していた米金利もやや回復基調にあるため、ドル売り円買いの流れが継続するとは考えづらく、本日はドル買い優勢の展開となる可能性が高そうだ。ただ、中東の地政学リスクは依然として残っているため、中東情勢に関するヘッドラインには気を付けたい。

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に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:南野・鈴木