

みずほCustomer Desk Report 2024/11/28号(As of 2024/11/27)
【昨日の市況概要】

	USD/JPY	EUR/USD	EUR/JPY	GBP/USD	AUD/USD	公示値	152.92
TKY 9:00AM	152.93	1.0493	160.38	1.2574	0.6477		
SYD-NY High	153.22	1.0587	160.65	1.2694	0.6500		
SYD-NY Low	150.45	1.0475	159.13	1.2569	0.6457		
NY 5:00 PM	151.13	1.0566	159.74	1.2679	0.6497		
	終値	(前日比)		終値	(前日比)		
NY DOW	44,722.06	▲ 138.25	日本2年債	0.5900%	0.0000%		
NASDAQ	19,060.48	▲ 113.82	日本10年債	1.0700%	0.0100%		
S&P	5,998.74	▲ 22.89	米国2年債	4.2293%	▲ 0.0176%		
日経平均	38,134.97	▲ 307.03	米国5年債	4.1328%	▲ 0.0492%		
TOPIX	2,665.34	▲ 24.21	米国10年債	4.2595%	▲ 0.0340%		
シカゴ日経先物	37,825.00	▲ 530.00	独10年債	2.1660%	▲ 0.0320%		
ロンドンFT	8,274.75	16.14	英10年債	4.2950%	▲ 0.0570%		
DAX	19,261.75	▲ 34.23	豪10年債	4.4340%	▲ 0.0020%		
ハンセン指数	19,603.13	443.93	USDJPY 1M Vol	12.03%	0.53%		
上海総合	3,309.78	50.02	USDJPY 3M Vol	11.14%	0.26%		
NY金	2,639.90	18.60	USDJPY 6M Vol	10.68%	0.09%		
WTI	68.72	▲ 0.05	USDJPY 1M 25RR	▲ 1.77%	Yen Call Over		
CRB指数	286.72	▲ 1.30	EURJPY 3M Vol	11.22%	0.23%		
ドルインデックス	106.08	▲ 0.93	EURJPY 6M Vol	10.79%	▲ 0.00%		

東京

東京時間のドル円は152.93レベルでオープン。仲値近辺に153.03をつけるも、トランプ氏による関税政策への警戒感に加え翌日に米国休日を控えたポジション調整の動きもあってか、その後は軟調な推移。淡々と値を切り下げ、安値となる152.15レベルで海外時間へ渡った。

ロンドン

ロンドン市場のドル円は、152.15レベルでオープン。感謝祭前のSpot月末にて、月初のトランプ氏当選から買われていたドルの調整圧力が高まり、断続的なドル売りが続き151.20レベルまで下落する。その後、大きな反発もなく151.50レベルでNYに渡った。米FOMC議事要旨には時間をかけて利下げを進める旨が記載あり、金利も下落傾向で推移した。

ニューヨーク

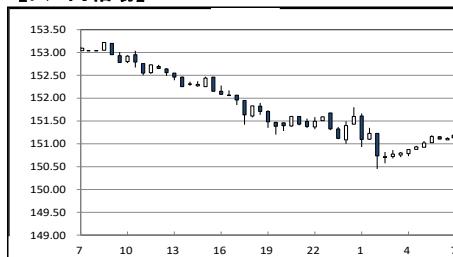
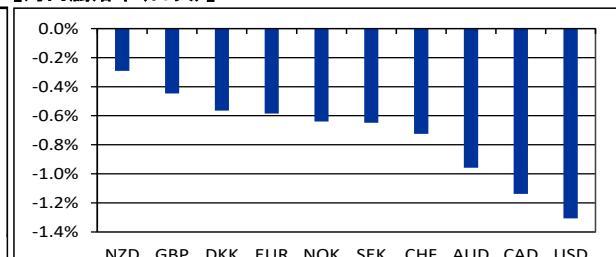
海外市場のドル円は、月末やオプション絡みのフロー、キャリートレードの解消の動きからドル売り、円戻しが優勢となり、一時5週間ぶりに151.20レベルまで下落し、151.51レベルでNYオープン。朝方は米GDP価格指数が予想を上回ったことから一旦151.67レベルまで戻すものの、同時に発表された米新規失業保険申請件数がほぼ予想と一致する一方、引き続き失業保険継続受給者数が徐々に上昇傾向にあることが確認され、その後も月末の債券買いのフローもあり、米金利が低下する展開に151円ちょうどまで反落する。統計で発表の10月PCE価格指数が予想と一致し、ドル円の反応は限定的となるが、円のショートカバーが一服する中、ドル円は151.80レベルまで戻す。しかし、特段のニュースが見当たらない中、150.45レベルまで反落する。午後は、サクスキビングを前に、徐々に市場参加者数が減少する中、調整から151.19レベルまで戻し、151.13レベルでクローズした。一方、海外市場で月末絡みの調整のドル売りが優勢となったことからユーロドルは1.0540まで戻し、1.0528でNYオープン。朝方はショートカバーから1.0579まで戻す。その後一旦売り戻される局面もあったものの、月末の調整が継続し1.0587まで戻す。午後はサクスキビングを控え流動性が低下する中、狭いレンジでの推移が続き、1.0566でクローズした。

【昨日の指標等】

Date	Time	Event	結果	予想
11月27日	09:30	豪 CPI(前年比)	10月 2.1%	2.3%
	09:30	豪 CPIトータル平均値(前年比)	10月 3.5%	—
	22:30	米 GDP(年率/前期比)	3Q S 2.8%	2.8%
	22:30	個人消費	3Q S 3.5%	3.7%
	22:30	米 卸売在庫(前月比)・速報	10月 0.2%	0.1%
	22:30	米 耐久財受注(前月比)・速報	10月 0.2%	0.5%
	22:30	米 新規失業保険申請件数	23-Nov 213k	215k
	00:00	米 PCE価格指数(前月比/前年比)	10月 0.2%/2.3%	0.2%/2.3%
	00:00	米 中古住宅販売仮契約(前月比)	10月 2.0%	-2.0%
	03:00	欧 レーン・ECB専務理事講演	—	—

【本日の予定】

Date	Time	Event	予想	前回
11月28日	19:00	欧 消費者信頼感・確報	11月 —	-13.7
	19:00	欧 サービス業信頼感指数	11月 6.5	7.1
	19:00	欧 鉱工業信頼感指数	11月 -13	-13
	22:00	独 CPI・速報(前年比/前月比)	11月 2.3%/-0.2%	2%/0.4%

【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	149.50—152.50	1.0500—1.0610	158.20—160.20

【マーケット・インプレッション】

昨日海外市場のドル円は東京時間に大幅に下落した流れを引き継ぎ上値が重い展開だった。米国の第3QのGDPをはじめとした重要指標の結果は強弱まちまちだったため方向感は出す。しかし、米国7年債入札後に米長期金利がその低下幅を拡大するとドル円の下落は加速し、10/21以来の水準の150.45円をマークした。本日は、円売りポジションが大きく解消された翌日かつ米国は感謝祭による休日であり、流動性が低い。そのため、値が飛ぶ可能性が高いことから注意が必要。足元はトランプ次期政権にかかる情報や、地政学的リスクにポジションが振り回されているが、中長期的に見てトランプ次期政権によるドル信認の回復および財政インフレ懸念後退を理由に貨幣からの逃避資金が戻ってくるであればドル高目線は継続すると見込む。

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にお願い申上げます。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。