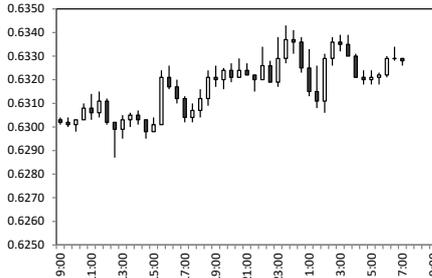


【外国為替】

| | 始値 | 高値 | 安値 | 終値 |
|---------|--------|--------|--------|--------|
| AUD/USD | 0.6302 | 0.6343 | 0.6287 | 0.6325 |
| AUD/JPY | 93.91 | 94.40 | 93.79 | 94.33 |
| USD/JPY | 149.02 | 149.32 | 148.74 | 149.12 |
| EUR/USD | 1.0467 | 1.0532 | 1.0451 | 1.0504 |
| NZD/USD | 0.5909 | 0.5925 | 0.5871 | 0.5913 |
| AUD/NZD | 1.0666 | 1.0723 | 1.0657 | 1.0697 |
| AUD/EUR | 0.6020 | 0.6042 | 0.6010 | 0.6021 |
| EUR/JPY | 155.97 | 156.77 | 155.83 | 156.65 |

*前営業日の値動き

【AUD/USD 24時間チャート】



【AUD/JPY 24時間チャート】



【主要政策金利・各国国債利回り】

| | 前営業日終値 | 前日比 |
|-----------------|--------------|--------|
| RBA (Cash Rate) | 4.10% | 25bp |
| FED (FF Rate) | 5.25 - 5.50% | 0.0bp |
| 米10年国債 | 4.733% | -6.3bp |
| 日10年国債 | 0.809% | 4.2bp |
| 豪10年国債 | 4.663% | 12.3bp |
| 独10年国債 | 2.919% | -4.9bp |
| 英10年国債 | 4.579% | -1.8bp |

【主要株価】

| | 前営業日終値 | 前日比 | 騰落率 |
|----------|--------|------|-------|
| NYダウ | 33,130 | 127 | 0.4% |
| ナスダック総合 | 13,236 | 177 | 1.4% |
| S&P500 | 4,264 | 34 | 0.8% |
| 日経平均株価 | 30,527 | -711 | -2.3% |
| 豪州ASX200 | 6,890 | -53 | -0.8% |
| 上海総合 | - | - | - |
| 独DAX | 15,100 | 15 | 0.1% |
| 英FTSE | 7,412 | -58 | -0.8% |

【コモディティ価格】

| | 前営業日終値 | 前日比 | 騰落率 |
|---------------------|----------|-------|-------|
| 鉄鉱石(鉄分62%) offshore | 118.03 | -0.41 | -0.3% |
| 一般炭(Newcastle) | 144.65 | -5.00 | -3.3% |
| 原料炭(Australia-SGX) | 361.00 | 11.00 | 3.1% |
| NY原油先物(WTI) | 84.22 | -5.01 | -5.6% |
| NY天然ガス先物(HenryHub) | 2.96 | 0.01 | 0.4% |
| NY金先物 | 1,834.80 | -6.70 | -0.4% |

*上記全て基準日は前営業日

(Data Source: Bloomberg)

【トピックス、経済指標、豪ドル推移、注目点等】

予想レンジ: AUD/USD: 0.6240-0.6450 AUD/JPY: 93.00-95.50

【前日のマーケット/本日の見通し】

水曜日の豪ドルは0.63近辺でスタート。RBNZによる政策金利5.5%据え置きを受け、対ドルでは特段の動きは見られなかったものの、タカ派失望感からAUD/NZDは1.0660近辺から1.0710近辺へ上昇した。NY時間に発表された米9月ADP雇用統計は予想、前回値を共に下回り、労働需要が鈍化している兆候が示唆された事や、またISM非製造業景況指数が前回は下回った事で米債利回り上昇が一服し、豪ドルは0.6343まで上昇。その後は0.63台前半で振幅し0.6325でNY引けとなった。

本日は米新規失業保険申請件数、失業保険継続受給者数が予定されている。これまで労働市場の底堅さが個人消費、米経済を押し上げてきたが、労働市場減速により米追加利上げ期待が後退していく可能性がある。本日のデータでも米労働市場の減速が示されれば更に米債利回り上昇の動きが抑制されるとみる。まずは米9月雇用統計を占う上でも本日の新規失業保険申請件数をみたい。

【前日経済指標/イベント】 (出所: Bloomberg)

| 時刻 | 国名 | イベント | 期間 | 調査 | 実績 | 前回 | 修正 |
|------------------|----|-----------------------------|--------|-------|--------|--------|-------|
| 10/04/2023 09:00 | AU | ジュート・バンク・オーストラリアPMIコンボジット | Sep F | -- | 51.5 | 50.2 | -- |
| 10/04/2023 09:00 | AU | ジュート・バンク・オーストラリアPMIサビ工業 | Sep F | -- | 51.8 | 50.5 | -- |
| 10/04/2023 11:30 | JN | auじぶん銀行日本複合PMI | Sep F | -- | 52.1 | 51.8 | -- |
| 10/04/2023 11:30 | JN | auじぶん銀行日本サビ工業PMI | Sep F | -- | 53.8 | 53.3 | -- |
| 10/04/2023 12:00 | NZ | RBNZファイナル・キャシュレート | Oct-04 | 5.50% | 5.50% | 5.50% | -- |
| 10/04/2023 12:00 | NZ | RBNZ Monetary Policy Review | | | | | |
| 10/04/2023 22:00 | US | MBA住宅ローン申請指数 | Sep-29 | -- | -6.00% | -1.30% | -- |
| 10/04/2023 23:15 | US | ADP雇用統計 | Sep | 150k | 89k | 177k | 180k |
| 10/05/2023 00:45 | US | S&P500・ローバル米国サビ工業PMI | Sep F | 50.2 | 50.1 | 50.2 | -- |
| 10/05/2023 00:45 | US | S&P500・ローバル米国コンボジットPMI | Sep F | 50.1 | 50.2 | 50.1 | -- |
| 10/05/2023 01:00 | US | 製造業受注(前月比) | Aug | 0.30% | 1.20% | -2.10% | -- |
| 10/05/2023 01:00 | US | 製造業受注(除輸送) | Aug | 0.20% | 1.40% | 0.80% | 0.90% |
| 10/05/2023 01:00 | US | 耐久財受注(前月比) | Aug F | 0.20% | 0.10% | 0.20% | -- |
| 10/05/2023 01:00 | US | 耐久財受注(除輸送用機器) | Aug F | 0.40% | 0.40% | 0.40% | -- |
| 10/05/2023 01:00 | US | ISM非製造業景況指数 | Sep | 53.5 | 53.6 | 54.5 | -- |
| 10/05/2023 01:00 | US | ISM非製造業仕入価格 | Sep | -- | 58.9 | 58.9 | -- |
| 10/05/2023 01:00 | US | ISM非製造業雇用 | Sep | -- | 53.4 | 54.7 | -- |
| 10/05/2023 01:00 | US | ISM非製造業新規注文 | Sep | -- | 51.8 | 57.5 | -- |

【本日経済指標/イベント】 (出所: Bloomberg)

| 時刻 | 国名 | イベント | 期間 | 調査 | 実績 | 前回 | 修正 |
|------------------|----|---|--------|----------|----|----------|----|
| 10/05/2023 11:00 | NZ | ANZ Commodity Price MoM | Sep | -- | -- | -2.90% | -- |
| 10/05/2023 11:00 | NZ | NZ Government 12-Month Financial Statements | | | | | |
| 10/05/2023 11:30 | AU | 輸出(前月比) | Aug | -- | -- | -2% | -- |
| 10/05/2023 11:30 | AU | 輸入(前月比) | Aug | -- | -- | 3% | -- |
| 10/05/2023 11:30 | AU | 貿易収支 | Aug | A\$8700m | -- | A\$8039m | -- |
| 10/05/2023 22:30 | US | チャレンジ・ヤー人員削減数(前年比) | Sep | -- | -- | 266.90% | -- |
| 10/05/2023 23:30 | US | 貿易収支 | Aug | -\$59.8b | -- | -\$65.0b | -- |
| 10/05/2023 23:30 | US | 新規失業保険申請件数 | Sep-30 | 210k | -- | 204k | -- |
| 10/05/2023 23:30 | US | 失業保険継続受給者数 | Sep-23 | 1671k | -- | 1670k | -- |

連絡先: 関浩士/Sam Gillies/安藤愛/川口志保/Carlo Da Dalt TEL (02) 8273-3913

本資料中の相場見通しは、作成時点での当社担当者の意見であり、実際の取引における最終責任はお客様自身に帰するものであることをご承知願います。また本資料は当社が正確と信ずる情報源に基づいて作成しておりますが、その正確性については当社は責任を負うものではありません。