

IMM 通貨先物のポジション動向(2020年9月22日時点)

米ドル合成ポジションの売り持ち高が4週ぶりに拡大

- 米商品先物取引委員会(CFTC)が発表した IMM 通貨先物¹によると、投機筋(Non Commercial、非商業部門)による主要8通貨の米ドル合成ポジションの売り持ち高は、前週の317.5億ドルから345.4億ドルへと4週ぶりに拡大した(図表1)。
- 主要8通貨では、ユーロの買い持ち高は前週の264.4億ドルから279.3億ドルへと4週ぶりに拡大した。円の買い持ち高が前週の27.1億ドルから35.2億ドルへと前週に続き拡大した。
- このほか、スイスフランの買い持ち高は前週の16.6億ドルから21.6億ドルへ前週に続き拡大となった。NZドルの買い持ち高が前週の2.2億ドルから3.2億ドルへ3週ぶりに拡大した。英ポンドの買い持ち高が前週の1.8億ドルから2.4億ドルへ拡大した。
- 一方、カナダドルの売り持ち高は前週の12.8億ドルから14.2億ドルへ5週ぶりに拡大した。
- このほか、豪ドルの買い持ち高は前週の11.8億ドルから11.7億ドルへ縮小した。メキシコペソの買い持ち高は前週の6.3億ドルから6.1億ドルへ4週ぶりに縮小した。
- 上記主要8通貨合成ポジションの構成通貨ではないが、ブラジルレアルの売り持ち高は、前週の4.7億ドルから4.3億ドルへ前週に続き縮小した。ロシアルーブルは前週の2.6億ドルの買い持ちから1.1億ドルの売り持ちに転じた。

市場営業部

チーフマーケット・エコノミスト

唐鎌 大輔

03-3242-7065

daisuke.karakama@mizuho-bk.co.jp

マーケット・エコノミスト

堀内 隆文

03-3242-7065

takafumi.horiuchi@mizuho-bk.co.jp

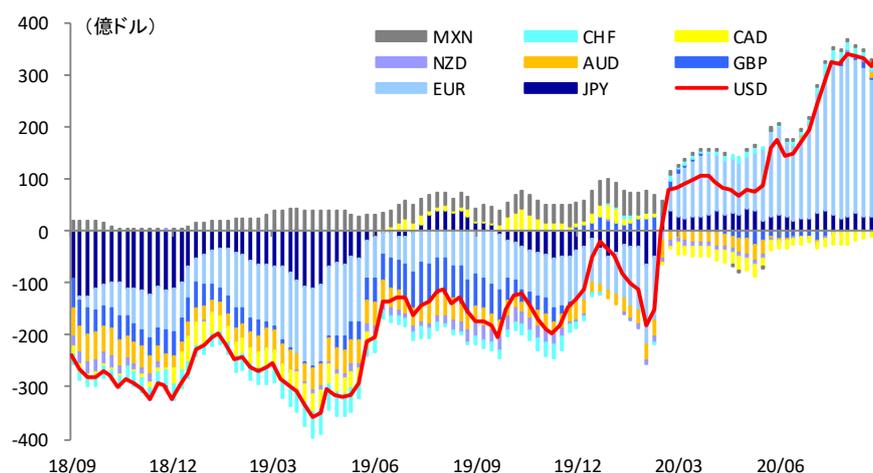
マーケット・エコノミスト

堀 堯大

03-3242-7065

takahiro.hori@mizuho-bk.co.jp

図表1:IMM 通貨先物のネット・ポジション(Non-Commercial、主要8通貨合成)



(注)ここでは、プラスは各通貨買い/ドル売り、マイナスは各通貨売り/ドル買いを示す。USD ネット・ポジションは各通貨のネット・ポジションの合計値。

(資料)CFTC、ブルームバーグ、みずほ銀行

¹ IMM 通貨先物とは、CME(シカゴ・マーカンタイル取引所)で取引されている通貨先物のポジションに関する週次統計であり、毎週金曜日に火曜日の取引終了時点のポジション(建玉)が発表される。

お客さま各位

ここではレポートの一部をご紹介します。
しています。

レポート全ページをご希望の方は、
お取引いただいているみずほ銀行の
お取扱店、またはお取引担当部まで
お問い合わせください。

以上