

IMM 通貨先物のポジション動向(2018年11月13日時点)

ドルの買い持ち高が縮小

- 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は、買い持ち高が前週の 302.2 億ドルから 283.5 億ドルへ 3 週ぶりに縮小した(図表 1)。
- 主要 8 通貨では、ユーロの売り持ち高が前週の 66.9 億ドルから 52.2 億ドルへ 7 週目にして初めて縮小。英ポンドの売り持ち高も前週の 46.5 億ドルから 38.2 億ドルへ 3 週ぶりに縮小した。
- また、豪ドルの売り持ち高が前週の 48.2 億ドルから 43.1 億ドルへ縮小、NZ ドルの売り持ち高は前週の 17.3 億ドルから 14.1 億ドルへ縮小した。いずれも売り持ち高の縮小は 2 週連続。スイスフランも売り持ち高が前週の 24.9 億ドルから 23.1 億ドルへ縮小した。
- 一方、円の売り持ち高は前週の 98.2 億ドルから 112.4 億ドルへ拡大。カナダドルも売り持ち高が前週の 2.0 億ドルから 2.1 億ドルへ小幅拡大した。メキシコペソの買い持ち高は前週の 1.8 億ドルからほぼ横ばいとなった。
- 上記主要 8 通貨合成ポジションの構成通貨ではないが、ロシアルーブルは買い持ち高が前週の 1.7 億ドルから 3.7 億ドルへと 3 週連続で拡大した。一方、ブラジルリアルは買い持ち高が前週の 1.0 億ドルから 0.8 億ドルへ小幅縮小した。

国際為替部

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

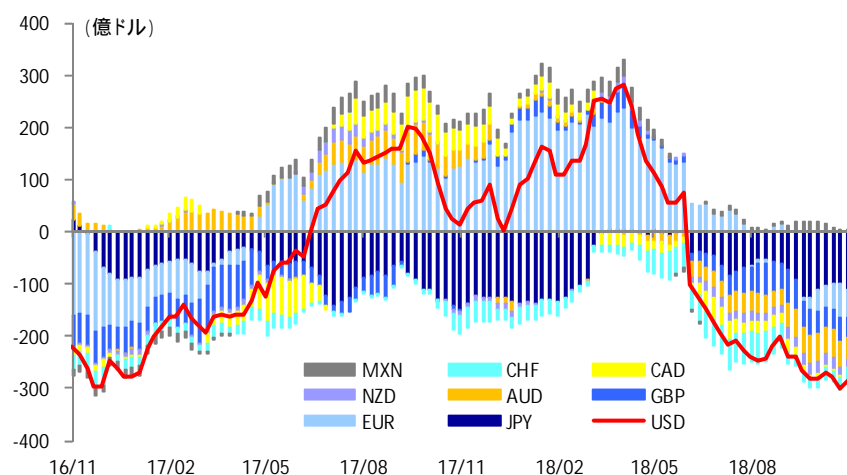
マーケット・エコノミスト

多田出 健太

03-3242-7065

kenta.tadaide@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