

IMM 通貨先物のポジション動向(2018年6月12日時点)

ドルの売り持ち高が2週連続で拡大

- 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は、売り持ち高が前週の55.8億ドルから73.9億ドルへと2週連続で拡大した(図表1)。
- 主要8通貨では、円が前週の3.9億ドルの売り持ちから5.7億ドルの買い持ちに転じた。また、豪ドルの売り持ち高は前週の15.4億ドルから11.5億ドルへと2週連続で縮小した。
- 英ポンドの買い持ち高は前週の6.1億ドルから9.2億ドルへと拡大し、スイスフランの売り持ち高は前週の49.8億ドルから47.2億ドルへと2週連続で縮小した。
- このほか、NZドルは買い持ち高が前週の3.1億ドルから4.9億ドルへ2週連続で拡大したほか、カナダドルの売り持ち高は前週の12.4億ドルから11.5億ドルへと縮小した。
- 他方、メキシコペソの売り持ち高は前週の2.7億ドルから5.2億ドルへ拡大し、ユーロの買い持ち高は前週の130.7億ドルから129.5億ドルへと8週連続で縮小し、2017年12月19日以来の低水準となった。
- 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4.7億ドルから4.8億ドルへと拡大し、ブラジルレアルの売り持ち高は前週の7.9億ドルから7.7億ドルに縮小した。

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

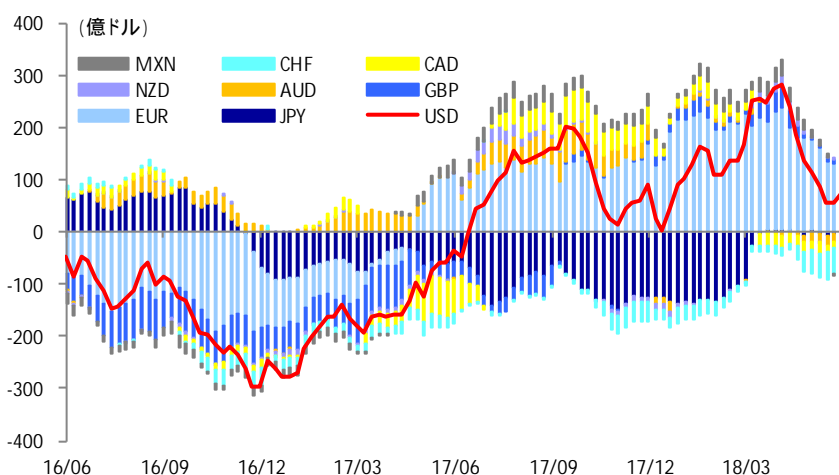
マーケット・エコノミスト

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