

IMM 通貨先物のポジション動向(2018年4月17日時点)

ユーロの買い持ち高は統計開始以来の最高水準を更新

- 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 272.5 億ドルから 282.7 億ドルへと 2 週連続で拡大した(図表 1)。
- 主要 8 通貨では、ユーロの買い持ち高は前週の 227.8 億ドルから 234.2 億ドルへと 2 週連続で拡大し、データが公表され始めた 1999 年 1 月 5 日以来の最高水準を更新した。
- 英ポンドは買い持ち高が前週の 38.1 億ドルから 42.6 億ドルへ 6 週連続で拡大し、2014 年 7 月 8 日以来の高水準を記録した。NZ ドルも買い持ち高が前週の 16.8 億ドルから 20.3 億ドルへ 3 週連続で拡大し、2017 年 8 月 8 日以来の高水準を記録したほか、メキシコペソも買い持ち高が前週の 28.0 億ドルから 28.2 億ドルへ 4 週連続で拡大した。
- このほか、カナダドルの売り持ち高は前週の 25.1 億ドルから 24.2 億ドルへと 3 週ぶりに縮小し、スイスフランも売り持ち高が前週の 14.0 億ドルから 13.6 億ドルへと 5 週ぶりに縮小した。
- 一方、円の買い持ち高は前週の 3.2 億ドルから 3.0 億ドルへと 2 週連続で縮小した。豪ドルの売り持ち高は前週の 2.2 億ドルから 7.9 億ドルへと 2 週連続で拡大した。
- 上記主要 8 通貨合成ポジションの構成通貨ではないが、ロシアルーブルは買い持ち高が前週の 6.1 億ドルから 5.7 億ドルへと縮小。ブラジルレアルの売り持ち高は前週の 6.51 億ドルから 6.55 億ドルへと拡大した。

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

佐々木 貴彦

03-3242-7065

takahiko.sasaki@mizuho-bk.co.jp

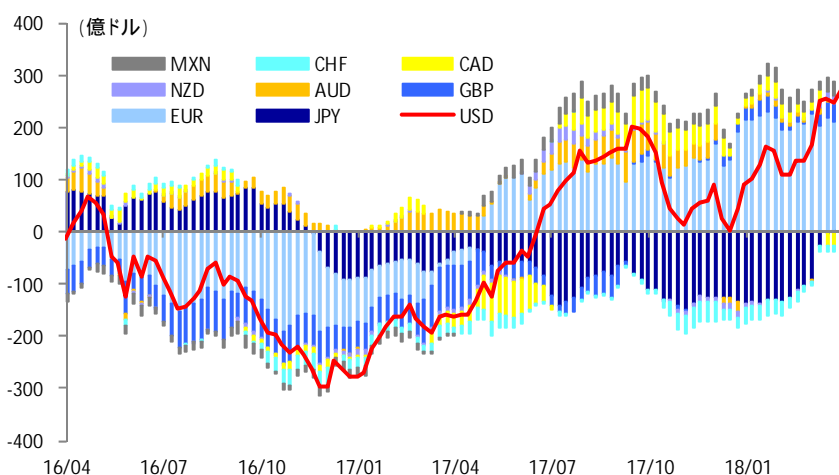
マーケット・エコノミスト

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