

Mizuho Daily Market Report

2023/9/26

為替

| 通貨 | アジア終値 | NY終値 | 前日比 | 前週比* |
|-----|--------|--------|---------|---------|
| JPY | 148.44 | 148.88 | +0.51 | +1.27 |
| EUR | 1.0638 | 1.0593 | ▲0.0060 | ▲0.0099 |
| AUD | 0.6422 | 0.6424 | ▲0.0017 | ▲0.0013 |
| SGD | 1.3666 | 1.3663 | +0.0011 | +0.0030 |
| CNY | 7.3112 | 7.3120 | +0.0130 | +0.0208 |
| MYR | 4.6845 | 4.6865 | ▲0.0030 | ▲0.0035 |
| THB | 36.08 | 36.13 | +0.12 | +0.40 |
| IDR | 15402 | 15400 | +25 | +30 |
| PHP | 56.78 | 56.78 | ▲0.02 | ▲0.09 |
| INR | 83.11 | 83.15 | +0.21 | ▲0.12 |
| VND | 24376 | 24385 | +51 | +9 |

金利

| 国債利回り | 終値 | 前日比 | 前週比* |
|-------------|--------|----------|----------|
| 米国(10年) | 4.533% | +10.0 bp | +23.1 bp |
| 日本(10年) | 0.736% | ▲1.0 bp | +2.1 bp |
| ユーロ圏(10年) | 2.798% | +5.9 bp | +9.0 bp |
| オーストラリア(5年) | 4.045% | ▲3.1 bp | +9.5 bp |
| シンガポール(5年) | 3.329% | +1.7 bp | +9.5 bp |
| 中国(5年) | 2.543% | +2.2 bp | +3.4 bp |
| マレーシア(5年) | 3.705% | ▲1.1 bp | +5.6 bp |
| タイ(5年) | 2.845% | +2.1 bp | +8.1 bp |
| インドネシア(5年) | 6.409% | +0.3 bp | +3.3 bp |
| フィリピン(5年) | 6.127% | ▲0.1 bp | +4.2 bp |
| インド(5年) | 7.185% | +0.3 bp | +2.2 bp |
| ベトナム(5年) | 1.900% | ▲30.0 bp | ▲30.0 bp |

株

| 株価指数 | 終値 | 前日比 | 前週比* |
|---------------|-----------|-------|-------|
| DOW(米国) | 34,006.88 | +0.1% | ▲1.8% |
| N225(日本) | 32,678.62 | +0.9% | ▲2.5% |
| STOXX50(ユーロ圏) | 4,167.37 | ▲0.9% | ▲1.8% |
| ASX(オーストラリア) | 4,139.09 | ▲0.8% | ▲0.3% |
| FTSE(シンガポール) | 3,215.40 | +0.3% | ▲1.5% |
| SSEC(中国) | 3,115.61 | ▲0.5% | ▲0.3% |
| KLSE(マレーシア) | 66,023.69 | +0.0% | ▲2.3% |
| SETI(タイ) | 6,998.38 | ▲0.3% | +0.9% |
| JKSE(インドネシア) | 1,443.45 | ▲0.5% | ▲1.0% |
| PSE(フィリピン) | 6,172.84 | +0.5% | +0.8% |
| SENSEX(インド) | 1,507.36 | ▲1.0% | ▲1.3% |
| VNINDEX(ベトナム) | 1,153.20 | ▲3.3% | ▲4.8% |

商品

| 商品スポット・先物 | 終値 | 前日比 | 前週比* |
|-----------|----------|-------|-------|
| CRB | 284.94 | ▲0.4% | ▲1.5% |
| 金 | 8,075.40 | ▲1.1% | ▲2.7% |
| 原油(WTI) | 120.66 | ▲1.1% | ▲1.6% |
| 銅 | 1,915.92 | ▲0.5% | ▲0.9% |

*1週間前の終値と比較

【本日の予想レンジ】

| | | | |
|---------|--------|---|--------|
| USD/JPY | 147.00 | — | 149.00 |
| EUR/USD | 1.0600 | — | 1.0700 |
| AUD/USD | 0.6360 | — | 0.6550 |
| USD/SGD | 1.3620 | — | 1.3700 |
| USD/CNY | 7.2900 | — | 7.3400 |
| USD/MYR | 4.6800 | — | 4.7090 |
| USD/THB | 35.80 | — | 36.45 |
| USD/IDR | 15360 | — | 15400 |
| USD/PHP | 56.70 | — | 57.10 |
| USD/INR | 82.30 | — | 83.45 |
| USD/VND | 24100 | — | 24500 |

【本日の相場方向感】

| | | | |
|---------|----------|---|----------|
| USD/JPY | Bull (7) | > | Bear (1) |
| USD/SGD | Bull (8) | > | Bear (0) |

Contact:
Mizuho Bank, Ltd., Asia & Oceania Treasury Department
Tel: 65-6805-4100

【為替】

アジア時間のドル円は148円台半ばでオープン。ドル円は仲値付近にかけては底堅い推移となったものの、その後は介入警戒感もあってか上値の重い推移に、狭いレンジでの推移が続いた後、148円台前半にて海外時間に渡った。アジア通貨は概ね軟調推移。先週FOMC以降、米金利の上昇基調が続く中、ドル買い優勢の展開となった。

海外市場のドル円は底堅く推移し、148円台後半でNYオープン。NY朝方は海外時間の流れを引き続き、ドル買いが続く中続伸し、年初来高値を更新するも、149円台手前では伸び悩み展開となった。NY午後は米金利が高水準で推移する動きを背景に底堅い推移が続いた148円台後半でクロス。

【金利】

米債利回りは上昇。目立った材料には乏しかったものの、先週のFOMCでの効派寄りの結果が尾を引いている他、ケルズビ総裁から高インフレのリスクは高い、等の発言も出ている中で買い向かう動きも見られず大幅にベアスティフ化。

【予想】

本日のドル円は底堅い値動きを予想。先週日米の中銀会合を終え、両国の金融政策の格差が改めて意識されやすい状況。引き続き円安けん制発言に対する警戒感はあるものの、基本的にはドル買い優勢の展開が続くそう。

【本日の予定】

(日本) 8月 企業向けサービス価格指数、国債入札(40Y)、基調的なインフレ率を捕捉するための指標
(アジア) 8月 シンガポール 鉱工業生産
(アジア) 8月 タイ 製造業生産指数
(アジア) 8月 タイ 設備稼働率指数
(アジア) 8月 フィリピン 財政収支
(米国) 7月 FHFA住宅価格指数、8月 新築住宅販売件数
(米国) 9月 コンファレンスボード 消費者信頼感、9月 グラス連銀サービス業活動
(米国) 9月 フィデリティ連銀非製造業活動、9月 リッチモンド連銀製造業指数
(米国) 国債入札(2Y)