

Mizuho Daily Market Report

2023/10/26

為替

通貨	アジア終値	NY終値	前日比	前週比*
JPY	149.90	150.23	+0.32	+0.30
EUR	1.0587	1.0566	▲0.0024	+0.0030
AUD	0.6357	0.6309	▲0.0046	▲0.0027
SGD	1.3686	1.3707	+0.0022	▲0.0027
CNY	7.3157	7.3172	+0.0061	+0.0007
MYR	4.7792	4.7800	▲0.0055	+0.0330
THB	36.14	36.19	+0.02	▲0.09
IDR	15875	15870	+20	+140
PHP	56.86	56.86	+0.09	+0.15
INR	83.16	83.19	▲0.00	▲0.08
VND	24571	24571	+10	+39

金利

国債利回り	終値	前日比	前週比*
米国(10年)	4.955%	+13.2 bp	+4.0 bp
日本(10年)	0.859%	+0.8 bp	+5.0 bp
ユーロ圏(10年)	2.889%	+6.1 bp	▲3.5 bp
オーストラリア(5年)	4.374%	+7.9 bp	+8.6 bp
シンガポール(5年)	3.278%	+0.9 bp	▲3.8 bp
中国(5年)	2.555%	▲4.5 bp	▲3.8 bp
マレーシア(5年)	3.845%	+1.2 bp	+8.3 bp
タイ(5年)	2.972%	+0.8 bp	▲2.8 bp
インドネシア(5年)	7.126%	▲2.8 bp	+40.9 bp
フィリピン(5年)	6.586%	+15.5 bp	+23.2 bp
インド(5年)	7.334%	▲3.7 bp	▲2.5 bp
ベトナム(5年)	2.000%	+0.0 bp	+0.0 bp

株

株価指数	終値	前日比	前週比*
DOW(米国)	33,035.93	▲0.3%	▲1.9%
N225(日本)	31,269.92	+0.7%	▲2.4%
STOXX50(ユーロ圏)	4,073.35	+0.2%	▲0.8%
ASX(オーストラリア)	3,990.54	+0.2%	▲2.4%
FTSTI(シンガポール)	3,078.78	▲0.2%	▲1.8%
SSEC(中国)	2,974.11	+0.4%	▲2.8%
KLSE(マレーシア)	64,049.06	▲0.8%	▲2.8%
SETI(タイ)	6,834.39	+0.4%	▲1.3%
JKSE(インドネシア)	1,442.51	+0.5%	▲0.3%
PSE(フィリピン)	6,054.50	+0.2%	▲3.4%
SENSEX(インド)	1,401.70	+0.8%	▲2.5%
VNINDEX(ベトナム)	1,101.66	▲0.4%	▲0.2%

商品

商品スポット・先物	終値	前日比	前週比*
CRB	283.10	+0.4%	▲1.0%
金	1,979.72	+0.4%	+1.7%
原油(WTI)	85.39	+2.0%	▲3.3%
銅	7,958.50	▲0.3%	+0.7%

*1週間前の終値と比較

【本日の予想レンジ】

USD/JPY	149.30	—	151.00
EUR/USD	1.0470	—	1.0700
AUD/USD	0.6250	—	0.6460
USD/SGD	1.3600	—	1.3770
USD/CNY	7.2850	—	7.3380
USD/MYR	4.7120	—	4.8380
USD/THB	36.00	—	37.20
USD/IDR	15830	—	15970
USD/PHP	56.50	—	57.00
USD/INR	83.00	—	83.45
USD/VND	24,300	—	24,700

【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149円台後半でオープン。豪7~9月CPIが強含んで次回RBA利上げ期待からAUDが買われたものの、ドル円への影響は限定的。東京仲値にかけてドル買い圧力が強まり一時150円手前まで上昇したものの、150円には届かず跳ね返された。その後は動意薄く149円台後半で狭いレンジでの値動きとなり、そのまま海外に渡った。

アジア通貨はまちまち。中国全国人民代表大会常務委員会が景気支援に向け、1兆元(1370億ドル)の新規国債発行を承認したことを受けて投資家心理が改善し、域内株式は軒並み上昇。しかし、通貨はまちまちの値動きとなった。

海外市場のドル円は149円台後半でNYオープン。NY朝方は、狭いレンジでの推移が続き、米9月新築住宅販売件数が予想を大きく上回り、米金利も上昇したものの、介入警戒がドル円は上値を押さえられ、狭いレンジでの推移が続く。NY午後に入り5年債入札の弱い結果が発表されると金利が更に上昇したことから、150円ちょうどを数回タッチ。介入警戒からか売りが持ち込まれるものの、下げ幅は小さく、ここ最近150円手前の推移が続いたことから、急激な値動きが続いているわけではないので介入はないとの見方から再びじりじりと上昇し、特段ニュースが見当たらない中、米金利上昇を受けたドル買いに150円台前半まで上昇し、その水準でクローズした。

【金利】

米金利市場は、金利カーブが大きくスティープ化。NY朝方に発表された、9月新築住宅販売件数の数字が、予想、前回を上回る強い数字となったことで、債券市場では朝方より売り優勢となった。NY午後に入って本日の5年物国債の入札結果が発表され、不調な結果となったことから売りがさらに強まり、発表後一段と金利上昇が見られた。10年債の利回りは一時4.96%台を付け、再度5%の大口を試す展開。

【予想】

本日のドル円は底堅い推移を予想。今まで介入警戒感によりなかなか超えることできなかった150円を抜けた。今までは介入への警戒感もあり上値が重かったものの、徐々に円売り圧力が戻ってくる可能性には留意したい。本日は米3Q GDP速報値の公表を控えている。市場予想は2Qの2.1%を上回る4.5%となっており、市場予想を上回る結果となれば、一段ドル買いが進展する可能性には留意が必要となりそうだ。

【本日の予定】

(日本) 9月 企業向けサービス価格指数
(日本) 9月 工作機械受注(確)
(アジア) 3Q 豪 輸入物価指数 / 輸出物価指数
(アジア) 9月 シンガポール 失業率
(アジア) 9月 シンガポール 鉱工業生産
(アジア) 9月 タイ 製造業生産指数 / 設備稼働率指数I
(欧州) 10月 英 英国産業連盟
(欧州) 3Q 西 失業率
(欧州) ECB政策理事会
(欧州) EU首脳会議(ブリュッセル)
(欧州) フランス ECB総裁会見
(米国) 10月 カンザスステイ連銀製造業活動
(米国) 3Q GDP(速) / GDP価格指数(速)
(米国) 3Q コアPCE価格指数(速)
(米国) 9月 中古住宅販売仮契約
(米国) 9月 卸売在庫(速) / 前渡商品貿易収支
(米国) 9月 小売在庫 / 耐久財受注(速)
(米国) 9月 製造業受注-資本財(速)
(米国) 国債入札(7Y)
(米国) 新規失業保険申請件数