

Mizuho Daily Market Report

2023/12/1

為替

通貨	アジア終値	NY終値	前日比	前週比*
JPY	147.08	148.20	+0.96	▲1.36
EUR	1.0950	1.0888	▲0.0081	▲0.0017
AUD	0.6634	0.6605	▲0.0012	+0.0047
SGD	1.3335	1.3373	+0.0044	▲0.0035
CNY	7.1317	7.1350	+0.0088	▲0.0126
MYR	4.6611	4.6625	+0.0105	▲0.0178
THB	35.06	35.19	+0.38	▲0.08
IDR	15491	15510	+115	▲45
PHP	55.50	55.49	+0.11	+0.09
INR	83.38	83.40	+0.07	+0.05
VND	24262	24261	▲9	+5

金利

国債利回り	終値	前日比	前週比*
米国(10年)	4.326%	+7.1 bp	▲7.8 bp
日本(10年)	0.672%	+0.0 bp	▲5.3 bp
ユーロ圏(10年)	2.447%	+1.5 bp	▲17.2 bp
オーストラリア(5年)	4.074%	+1.2 bp	▲11.3 bp
シンガポール(5年)	2.918%	▲1.0 bp	▲1.6 bp
中国(5年)	2.571%	▲0.7 bp	▲2.0 bp
マレーシア(5年)	3.626%	+0.2 bp	+0.5 bp
タイ(5年)	2.610%	▲0.8 bp	▲5.0 bp
インドネシア(5年)	6.666%	+3.5 bp	+0.1 bp
フィリピン(5年)	6.013%	▲0.1 bp	▲20.9 bp
インド(5年)	7.254%	+1.7 bp	+1.1 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)	35,950.89	+1.5%	+1.9%
N225(日本)	33,486.89	+0.5%	+0.1%
STOXX50(ユーロ圏)	4,382.47	+0.3%	+0.5%
ASX(オーストラリア)	4,053.80	+0.1%	▲0.5%
FTSTI(シンガポール)	3,072.99	▲0.4%	▲1.2%
SSEC(中国)	3,029.67	+0.3%	▲1.1%
KLSE(マレーシア)	66,988.44	+0.1%	+1.5%
SETI(タイ)	7,080.74	+0.6%	+1.1%
JKSE(インドネシア)	1,452.74	+0.5%	▲0.0%
PSE(フィリピン)	6,223.73	▲0.7%	▲0.4%
SENSEX(インド)	1,380.18	▲0.5%	▲1.9%
VNINDEX(ベトナム)	1,094.13	▲0.8%	+0.5%

商品

商品スポット・先物	終値	前日比	前週比*
CRB	273.64	▲0.7%	▲0.5%
金	2,036.41	▲0.4%	+2.2%
原油(WTI)	75.96	▲2.4%	#VALUE!
銅	8,387.50	+0.6%	+1.0%

*1週間前の終値と比較

【本日の予想レンジ】

USD/JPY	146.80	—	148.50
EUR/USD	1.0870	—	1.1070
AUD/USD	0.6530	—	0.6660
USD/SGD	1.3220	—	1.3430
USD/CNY	7.1150	—	7.2030
USD/MYR	4.6370	—	4.7030
USD/THB	34.60	—	36.20
USD/IDR	15330	—	15570
USD/PHP	55.00	—	57.00
USD/INR	82.80	—	83.65
USD/VND	24,100	—	24,800

【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147円台前半でオープン。オープン後、小幅上昇したものの米国の早期利下げ織り込みを背景としたドル安地合いに上値が重い値動きが継続。その後は特段目立った材料のない中、月末フローが交錯し147円を挟んで方向感なく推移。結局146円台後半で海外時間に渡った。アジア通貨は方向感に欠ける展開。アジア時間こそ米州時間に予定されるPCEデフレーター発表を控え小動きとなったが、欧州時間入り際から米金利上昇を受けたドル買いの流れが優勢となり多くの通貨が対ドルで下落。タイバツはアジア時間34.90近辺で小動きとなったが、欧州時間入り際には35.20近辺まで上昇した。

海外市場のドル円は欧州時間に米金利上昇を受けたドル買いが優勢となり147円台後半まで上昇。米州時間朝方には複数の米経済指標結果が発表され、米失業保険継続受給者数は予想より悪化、米10月個人支出と米10月PCEコアデフレーターでは共に伸びが鈍化している等の内容を受け、147円台前半まで反落。その後、デリリー・サンフランシスコ連銀総裁の「現在利下げは全く考えていない」、ウィリアムズ・ニューヨーク連銀総裁の「インフレが続けば、追加引き締めが必要になる公算」等の発言を受け、米金利上昇と月末絡みのドル買いフローが相まって、148円台半ばまで上昇。買い一巡後はロンドンフィクシングに掛けて、一転ドル売りが優勢となり147円台後半まで反落したが、米州時間午後にかけては米金利の高止まり展開を眺めながら、ドル円は再び148円台前半まで戻しクローズした。

【金利】

米金利市場は、金利カーブがスティープ化。今週に入って利上げ終了観測の強まりから買い優勢が続いていたが、注目されていた消費指標が予想通りとなったことや、月末の調整売りもあり、金利は上昇に転じた。FED要人が、利下げを想定するのは時期尚早と発言したことも、金利上昇材料となった。

【予想】

本日のドル円は底堅い値動きを予想。昨日のウィリアムズNY連銀総裁のコメントを受け、米金利上昇の流れが継続するものと予想。

【本日の予定】

(日本) 10月 失業率 / 有効求人倍率
(日本) 11月 製造業PMI(確)
(日本) 3Q 設備投資 / 企業利益
(アジア) (韓国、マレーシア、タイ、ベトナム、
(アジア) 11月 NZ ANZ消費信頼感指数
(アジア) 11月 PMI製造業
(アジア) 11月 インド PMI製造業
(アジア) 11月 インドネシア CPI
(アジア) 11月 中国 Caixin中国製造業PMI
(アジア) 11月 豪 PMI製造業(確)
(アジア) 11月 韓国 貿易収支
(欧州) 11月 ユーロ圏 製造業PMI(確)
(米国) 10月 建設支出
(米国) 11月 ISM製造業景況指数
(米国) 11月 ワース自動車販売台数合計
(米国) 11月 製造業PMI(確)
(米国) ゲールズビー・シカゴ連銀総裁講演
(米国) ハウエルFRB議長講演
(米国) ハウエルFRB議長講演、クックFRB理事講演

当資料は情報提供のみを目的として作成したものであり、特定の取引の勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると判断した情報に基づいて作成されていますが、その正確性、確実性を保証するものではありません。ここに記載された内容は事前連絡なしに変更されることもあります。投資に関する最終決定はお客様ご自身の判断でなさるようお願い申し上げます。また、当資料の著作権はみずほ銀行に属し、その目的を問わず無断で引用または複製することを禁じます。転送もお控えください。なお、当行は本情報を無償でのみ提供しております。当行からの無償の情報提供を望まない場合、配信停止を希望する旨をお申し出ください。