

Mizuho Daily Market Report

2024/2/29

為替

通貨	アジア終値	NY終値	前日比	前週比*
JPY	150.73	150.57	+0.00	+0.27
EUR	1.0823	1.0848	+0.0000	+0.0029
AUD	0.6509	0.6535	+0.0000	▲0.0016
SGD	1.3457	1.3446	+0.0000	+0.0006
CNY	7.1992	7.1975	+0.0000	+0.0063
MYR	4.7634	4.7785	+0.0000	▲0.0158
THB	36.04	36.11	+0.00	+0.26
IDR	15688	15630	+0	▲5
PHP	56.26	56.09	+0.00	+0.13
INR	82.92	82.90	+0.00	▲0.07
VND	24627	24663	+0	+131

金利

国債利回り	終値	前日比	前週比*
米国(10年)	4.283%	+0.0 bp	▲3.5 bp
日本(10年)	0.702%	+0.0 bp	▲2.4 bp
ユーロ圏(10年)	2.440%	+0.0 bp	▲1.0 bp
オーストラリア(5年)	3.780%	+0.0 bp	+0.0 bp
シンガポール(5年)	3.028%	+0.0 bp	+1.0 bp
中国(5年)	2.231%	+0.0 bp	▲5.2 bp
マレーシア(5年)	3.595%	+0.0 bp	+3.5 bp
タイ(5年)	2.246%	+0.0 bp	▲0.8 bp
インドネシア(5年)	6.500%	+0.0 bp	▲1.2 bp
フィリピン(5年)	6.095%	+0.0 bp	+1.2 bp
インド(5年)	7.076%	+0.0 bp	+1.4 bp
ベトナム(5年)	1.650%	+0.0 bp	+0.0 bp

株

株価指数	終値	前日比	前週比*
DOW(米国)	39,069.23	+0.0%	+1.2%
N225(日本)	39,233.71	+0.0%	+2.5%
STOXX50(ユーロ圏)	4,864.29	+0.0%	+1.9%
ASX(オーストラリア)	4,190.80	+0.0%	+0.3%
FTSE(シンガポール)	3,171.12	+0.0%	▲1.4%
SSEC(中国)	2,977.02	+0.0%	+0.9%
SENSEX(インド)	72,790.13	+0.0%	+0.2%
JKSE(インドネシア)	7,283.82	+0.0%	▲0.9%
KLSE(マレーシア)	1,547.60	+0.0%	▲0.3%
PSE(フィリピン)	6,891.49	+0.0%	▲0.1%
SETI(タイ)	1,398.14	+0.0%	+0.3%
VNINDEX(ベトナム)	1,224.17	+0.0%	▲0.5%

商品

商品スポット・先物	終値	前日比	前週比*
CRB	273.64	+0.0%	▲0.1%
金	2,031.88	+0.0%	+0.3%
原油(WTI)	77.64	+0.0%	▲0.3%
銅	8,361.50	+0.0%	▲1.1%

*1週間前の終値と比較

【本日の予想レンジ】

USD/JPY	150.00	—	152.00
EUR/USD	1.0740	—	1.0860
AUD/USD	0.6490	—	0.6590
USD/SGD	1.3400	—	1.3480
USD/CNY	7.1850	—	7.2280
USD/INR	4.7460	—	4.8050
USD/THB	35.40	—	36.78
USD/IDR	15530	—	15700
USD/PHP	55.40	—	56.30
USD/INR	82.30	—	83.20
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150円台半ばの水準でオープン。月末の売りフローも入ってか取引時間序盤にやや下落。その後は豪1月月次CPIの不振を受けたAUDやRBNZの政策金利据え置きを受けたNZDを中心としたドル買いがサポートとなり、150円台半ばまでじりじりと値を戻し海外時間へ。アジア通貨は軟調。米インフレ統計の発表を前に様子見ムード。ドル金利の上昇も相まって大半のアジア通貨は軟調。

海外市場のドル円は米金利の上昇に連れり高推移となり、150円台後半の水準でNYオープン。NY時間朝方に発表された米第4四半期GDPが予想を下回り、発表直後はドル売りで反応し、150円台半ばまで下落。しかし、その後は構成項目の個人消費が予想を上回っている事が意識されてか、徐々にドルが買い戻され、150円台後半まで値を上げる。その後は買い一巡となり、150円台半ばまで反落。NY時間午後には複数のFRB高官が現状の政策金利を長く維持すると思わせる発言が伝わるも、ドル円は反応薄。その後は150円台後半での動意乏しい推移が続いた後、同水準を維持しクロス。

【金利】

米債市場はカーブがフラット化。4Q GDPは下方修正されたが主因は在庫の不振。個人消費や設備投資は上方修正され、米金利は一時上昇。翌日に1月PCEの発表を控える中、年3回利下げの見通しを維持するNY連銀総裁の発言もあり、終盤に金利低下。

【予想】

本日のドル円は月末のフローに振られる展開か。特にアジア時間は実需筋の外貨買いフローが相応に入ると予想。また海外時間には米1月PCEデフレタの発表を控えており、前年同月比での鈍化が確認されれば、これは市場予想通りの結果であり米利下げが意識され、ドル売り材料となろう。

【本日の予定】

(日本) 1月 住宅着工件数 / 住宅着工戸数、国債入札(2Y)
(日本) 基調的なインフレ率を捕捉するための指標、高田日銀審議委員会
(アジア) 12月 フィリピン 財政収支、1月 フィリピン 銀行貸出動向
(アジア) 1月 インド インフラ産業8業種、1月 インド 財政赤字
(アジア) 1月 シンガポール シンガポール国外居住者預金・残高
(アジア) 1月 タイ 国際収支:経常収支
(アジア) 1月 豪 小売売上高 / 民間部門信用
(アジア) 2月 中国 製造業PMI / 非製造業PMI
(アジア) 2月 豪 コアロジック住宅価格
(アジア) 4Q インド GDP / GVA
(アジア) 4Q 豪 民間設備投資
(アジア) インド 年間GDP予想
(欧州) 1月 英 住宅証券融資高 / 住宅ローン承認件数
(欧州) 1月 英 消費者信用残高
(欧州) 2月 独 CPI(速)
(欧州) 2月 独 失業者数 / 失業保険申請率
(米国) 1月 中古住宅販売仮契約
(米国) 1月 個人所得 / 個人支出
(米国) 1月 個消物価デフレタ / PCEコアデフレタ
(米国) 2月 MNIシカゴPMI
(米国) 2月 カンサスシティ連銀製造業活動
(米国) ゲールズビー・シカゴ連銀総裁講演
(米国) ホスティック・アトランタ連銀総裁講演
(米国) マスター・クラブランド連銀総裁講演
(米国) 新規失業保険申請件数

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、当資料の著作権は必ずしも銀行に属し、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れない場合、配信停止を希望する旨をお申し出ください。