

NYマーケットレポート (2021年1月21日)

2021年1月21日 (木)

| アジア主要株価指数 | 終値 | 前日比 | 年初来% | 外国為替 | 終値 | 高値 | 安値 |
|-----------|-----------|---------|--------|---------|--------|--------|--------|
| 日経平均 | 28,756.86 | +233.60 | 4.78% | USD/JPY | 103.51 | 103.67 | 103.33 |
| ハンセン指数 | 29,927.76 | -34.71 | 9.90% | EUR/JPY | 125.93 | 125.97 | 125.34 |
| 上海総合 | 3,621.26 | +36.82 | 4.27% | GBP/JPY | 142.13 | 142.22 | 141.37 |
| 韓国総合 | 3,160.84 | +46.29 | 10.00% | AUD/JPY | 80.36 | 80.51 | 80.17 |
| 豪ASX200 | 6,823.71 | +53.31 | 3.59% | EUR/USD | 1.2166 | 1.2174 | 1.2104 |
| シンガポールST | 3,017.15 | +18.38 | 6.10% | BRL/JPY | 19.246 | 19.645 | 19.084 |
| インドSENSEX | 49,624.76 | -167.36 | 3.92% | RUB/JPY | 1.395 | 1.405 | 1.388 |

| 欧州主要株価指数 | 終値 | 前日比 | 年初来% | コモディティ | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|----------------|-----------|---------|-------|---------|---------|--------|--------|
| 英FT100 | 6,715.42 | -24.97 | 3.95% | NY GOLD | 1865.90 | -0.60 | -1.77% |
| 仏CAC40 | 5,590.79 | -37.65 | 0.71% | NY 原油 | 53.13 | -0.18 | 9.25% |
| 独DAX | 13,906.67 | -14.70 | 1.37% | CBOTコーン | 523.25 | +1.25 | 8.28% |
| スペインIBX35 | 8,122.10 | -82.00 | 0.60% | CRB指数 | 175.163 | +0.019 | 4.39% |
| イタリアFTSE MIB | 22,428.93 | -221.85 | 0.88% | ドル指数先物 | 90.097 | -0.378 | 0.18% |
| トルコ・イスタンブール100 | 1,551.57 | -17.78 | 5.07% | VIX指数 | 21.32 | -0.26 | -6.29% |
| ロシアRTS | 1,463.84 | -23.06 | 5.51% | | | | |
| 南ア全株指数 | 64,174.88 | +66.37 | 8.02% | | | | |

| 米主要株価指数 | 終値 | 前日比 | 年初来% | Crypto Currency | 本日 | 前日 |
|-----------|-----------|--------|-------|--------------------|---------|---------|
| 米ダウ平均 | 31,176.01 | -12.37 | 1.86% | CME Bitcoin(先物・期近) | 31155 | 34930 |
| S&P500 | 3,853.07 | +1.22 | 2.58% | Ripple(XRP)【BSTP】 | 0.274 | 0.294 |
| NASDAQ | 13,530.91 | +73.67 | 4.99% | Ethereum【BSTP】 | 1171.48 | 1323.39 |
| 南北米主要株価指数 | | | | Bitcoin Cash | 436.35 | 494.73 |

| カナダ・トルント総合 | 終値 | 前日比 | 年初来% | オセアニア国債利回り | 本日 | 前日 |
|-------------|------------|----------|--------|--------------|---------|---------|
| カナダ・トルント総合 | 17,916.20 | -98.71 | 2.77% | オーストラリア10年債 | 1.112% | 1.089% |
| メキシコ・ボルサ指数 | 44,810.21 | -315.50 | 1.69% | ニュージーランド10年債 | 1.082% | 1.042% |
| ブラジル・ボヘスバ指数 | 118,328.99 | -1317.41 | -0.58% | 日本国債利回り | | |
| | | | | 2年債 | -0.120% | -0.118% |
| | | | | 10年債 | 0.043% | 0.049% |
| | | | | 30年債 | 0.647% | 0.667% |

*一部暫定値

1/22 経済指標スケジュール

08:30 【日本】12月全国消費者物価指数
 09:01 【英国】1月GfK消費者信頼感調査
 09:30 【オーストラリア】12月小売売上高
 14:30 【日本】12月全国百貨店売上高
 14:30 【日本】12月東京地区百貨店売上高
 16:00 【英国】12月公共部門純借入所要額
 16:00 【英国】12月公共部門純借入額
 16:00 【英国】12月小売売上高
 17:15 【フランス】1月製造業PMI・非製造業PMI
 17:30 【ドイツ】1月製造業PMI・非製造業PMI
 18:00 【欧州】1月製造業PMI・非製造業PMI
 18:00 【ポーランド】12月生産者物価指数
 18:00 【ポーランド】12月小売売上高
 18:30 【英国】1月製造業PMI・非製造業PMI
 22:30 【カナダ】11月小売売上高
 23:45 【米国】1月製造業PMI・非製造業PMI
 00:00 【米国】12月中古住宅販売件数

| 欧州国債利回り | 本日 | 前日 |
|-----------|---------|---------|
| ドイツ10年債 | -0.496% | -0.529% |
| 英国 10年債 | 0.331% | 0.301% |
| フランス 10年債 | -0.270% | -0.300% |
| イタリア 10年債 | 0.690% | 0.620% |
| スペイン 10年債 | 0.130% | 0.080% |
| 米国債利回り | | |
| 2年債 | 0.119% | 0.127% |
| 10年債 | 1.106% | 1.080% |
| 30年債 | 1.869% | 1.830% |

1/22 主要会議・講演・その他予定

- ・米20年債入札

NY 市場レポート（前日 22 時 00 分～午前 6 時 30 分まで）

主要な欧州経済指標の結果

欧州中銀 政策金利 0.25%（予想 0.25%・前回 0.25%）

上限政策金利[限界貸出金利] 0.00%（予想 0.00%・前回 0.00%）

下限政策金利[中銀預金金利] -0.50%（予想 -0.50%・前回 -0.50%）

ECB 声明

- ・ パンデミック緊急購入の規模を 1.85 兆ユーロで維持
- ・ 金利は現行水準またはそれより低い水準に留まると予想
- ・ パンデミック緊急購入の全額を使うとは限らない
- ・ TLTRO を通じ潤沢な流動性の供給を継続へ

ラガルド ECB 総裁の会見での主な発言

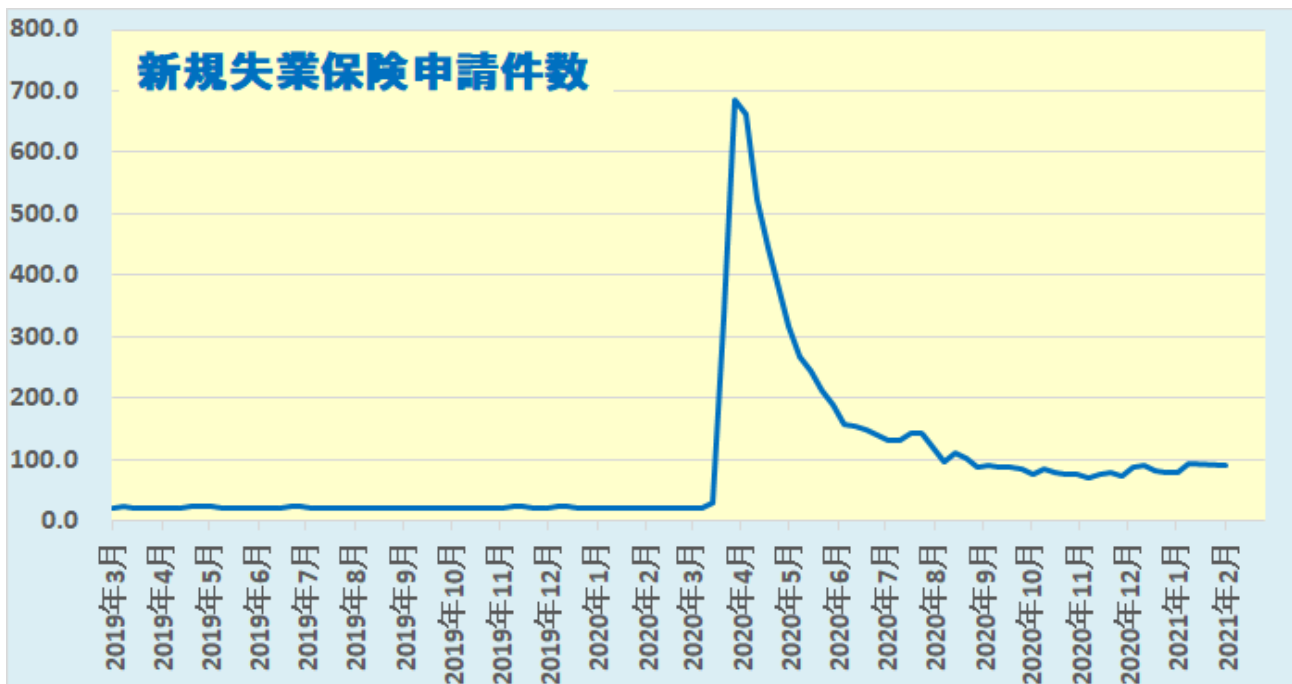
- ・ ユーロ圏経済は昨年 10-12 月に縮小
- ・ ECB は必要に応じ全ての政策措置を調整する用意がある
- ・ 経済動向は 12 月の基本予測にほぼ沿っている
- ・ 見通しへの下振れリスクは以前より顕著でなくなった
- ・ ECB は特定の利回りに縛られてはいない
- ・ 為替レートを極めて注意深く見守っている

主要な米経済指標の結果

新規失業保険申請件数 90.0 万件（予想 92.3 万件・前回 96.5 万件⇒92.6 万件）

失業保険継続受給者数 505.4 万人（予想 525.0 万人・前回 527.1 万人⇒518.1 万人）

米新規失業保険申請件数（1/16 までの週）は、前週比-2.6 万件となり、3 週ぶりに減少となった。ただ、依然として高水準に留まっており、新型コロナウイルスの感染再拡大による店舗などの営業規制が労働市場に影響していることが示された。一方、失業保険継続受給者数（1/9 までの週）は、前週比-12.7 万人と 2 週ぶりに減少となった。



データを基に SBILM が作成

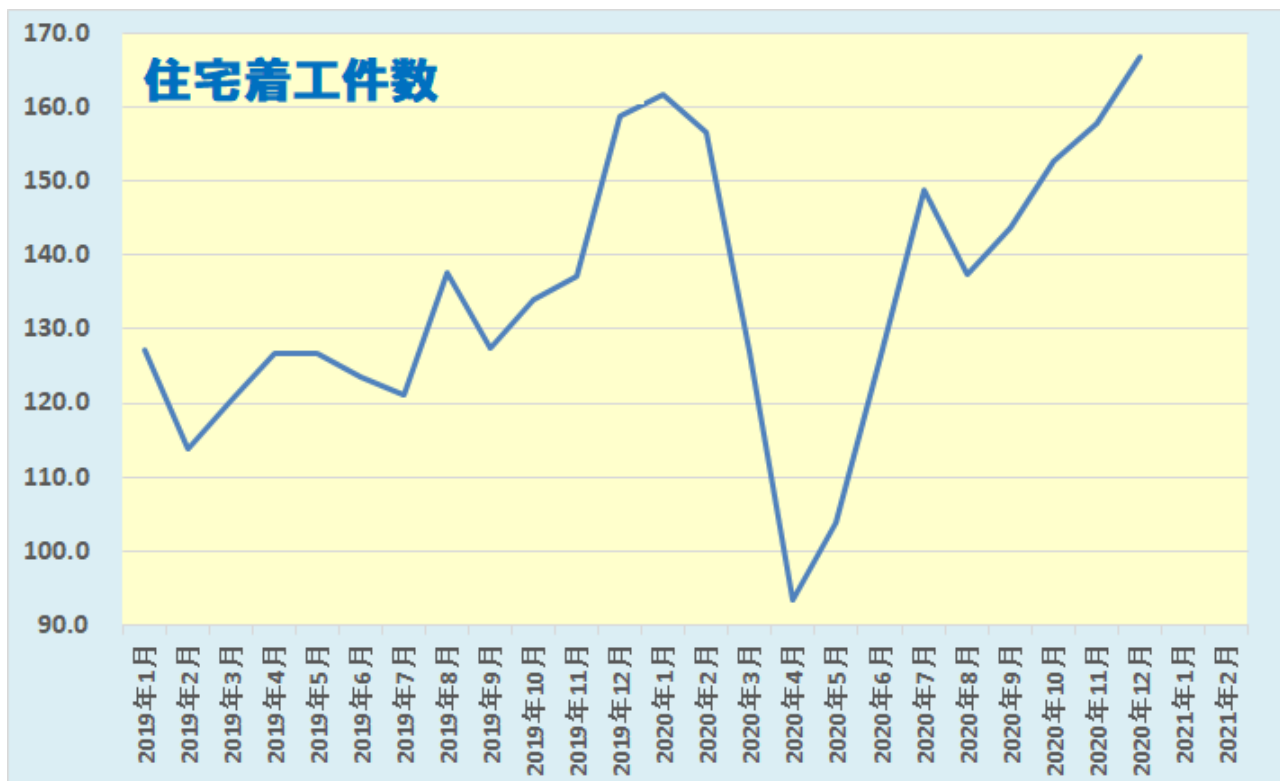
12月住宅着工件数 166.9万件（予想 156.0万件・前回 154.7万件⇒157.8万件）

12月住宅着工件数（前月比） 5.8%（予想 0.8%・前回 1.2%⇒3.1%）

12月建設許可件数 170.9万件（予想 160.3万件・前回 163.9万件）

12月建設許可件数（前月比） 4.5%（予想 -2.0%・前回 6.2%）

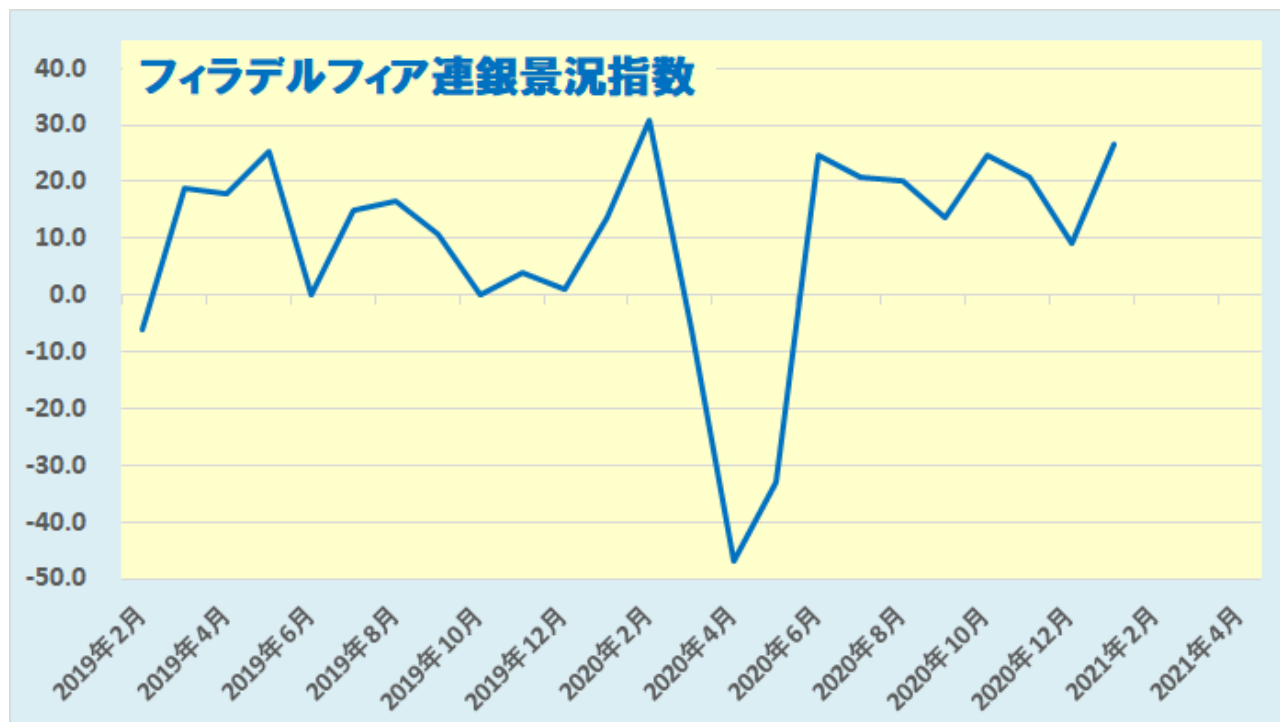
12月の米住宅着工件数は、前月比+5.8%となり、4ヵ月連続の増加となり、2006年9月以来、14年3ヵ月ぶりの高水準となった。低い住宅ローン金利に加え、新型コロナウイルスの流行により、郊外物件の需要が旺盛だったことが押し上げ要因となった。一戸建て住宅は+12.0%の133.8万件（前月119.5万件）、集合住宅は-13.5%の33.1万件（38.3万件）となり、地域別では中西部が+32.1%、西部が+10.2%、南部が+5.5%となったが、北東部は-34.8%と減少した。一方、着工件数の先行指標となる建設許可件数は、前月比+4.5%となり、着工件数が引き続き堅調な結果が続くと予想される。



データを基に SBILM が作成

1月フィラデルフィア連銀景況指数 26.5 (予想 11.3・前回 11.1)

1月の米フィラデルフィア連銀製造業景況指数は、市場予想を大幅に上回る結果となり、昨年2月以来の高水準となった。



データを基に SBILM が作成

ダウ平均は取引時間中の最高値を更新したものの、小幅安で終了

米株式市場では、バイデン米新政権が打ち出した経済対策の早期実現への期待感が根強く、ダウ平均株価が序盤に取引時間中の最高値を更新するなど、主要株価指数は堅調な動きとなった。その後は利益確定の動きからマイナス圏まで下落する動きとなり、ダウ平均株価は12.37ドル安（-0.04%）と小幅安で終了した。一方、ハイテク株中心のナスダックは、IT大手の良好な好決算見通しが下支え要因となり、73.67ポイント高（+0.55%）で終了し、取引時間中、終値ベースの最高値を連日更新した。



データを基に SBILM が作成

| セクター別変動率(ダウ平均) | | | 個別の変動率(ダウ平均銘柄) | | |
|----------------|-------|--------|----------------|-----------|--------|
| | セクター | 変動率 | | 銘柄 | 変動率 |
| 1 | 石油・ガス | -3.53% | 1 | シェブロン | -3.53% |
| 2 | 素材 | -1.72% | 2 | ウォルグリーンBA | -2.12% |
| 3 | 資本財 | -0.84% | 3 | ボーイング | -1.91% |
| 4 | 消費財 | -0.57% | 4 | DOW | -1.72% |
| 5 | 金融 | -0.10% | 5 | メルク | -1.55% |

データを基に SBILM が作成

ドルは序盤上昇も、その後は主要通貨に対して上値の重い動き

NY 市場では、序盤に発表された新規失業保険申請件数、12月の住宅着工件数、1月のフィラデルフィア連銀景況指数がいずれも良好な結果となったことを好感して、ドルは堅調な動きとなった。ドル/円は、一時 103.66 まで上昇したものの、アジア時間につけた高値の 103.67 には届かなかった。その後、上昇して始まり、序盤に取引時間中の最高値を更新したダウ平均株価がマイナス圏まで下落したこともあり、クロス円は上値の重い動きとなった。さらに、1.1194%まで上昇していた米 10 年債利回りが 1.0939%まで低下したことから、ドルは対円で上値の重い動きとなった。一方、ECB 理事会後の会見で、ラガルド ECB 総裁がワクチンの普及に期待を示し、見通しの下振れリスクが軽減したとの見方を示したことを好感してユーロ買いとなる場面もあったが、為替レートを注視しているとしたことが嫌気されて反落となった。ただ、終盤にかけてユーロは対ドルで上昇したことから、対円でも堅調な動きとなった。



出所：総合分析チャート

提供：SBI リクイディティ・マーケット株式会社

お客様は、本レポートに表示されている情報をお客様自身のためにのみご利用するものとし、第三者への提供、再配信を行うこと、独自に加工すること、複製もしくは加工したものを第三者に譲渡または使用させることは出来ません。情報の内容については万全を期しておりますが、その内容を保証するものではありません。また、これらの情報によって生じたいかなる損害についても、当社および本情報提供者は一切の責任を負いません。

本レポートに表示されている事項は、投資一般に関する情報の提供を目的としたものであり、勧誘を目的としたものではありません。投資にあたっての最終判断はお客様自身でお願いします。