

NYマーケットレポート(2013 年 1 月 17 日)

昨晚の外国為替市場は、NY 市場の序盤に発表された米失業保険申請件数が約 5 年ぶりの低水準となったことや、住宅着工件数が 4 年半ぶりの高水準となったことを受けて、ドル円・クロス円は、堅調な動きとなりました。また、スペイン国債の入札の結果が順調だったことなどを背景に、欧州の債務問題に対する懸念が後退したとの見方を受けて、ユーロは主要 16 通貨のすべてに対して堅調な動きとなりました。そして、午後には、日銀が来週 21~22 日に開く金融政策決定会合で、追加緩和を実施する方針を固めたと、日経電子版が報じたことを材料に円売りが優勢となり、ドル/円は一時 2010 年 6 月 23 日以来となる 90 円台に乘せる場面もありました。また、ユーロ/円は 2011 年 5 月 4 日以来、豪ドル/円は 2008 年 8 月以来の高値をそれぞれ更新する動きとなりました。

2013/1/17 (木)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	88.60	88.80	88.13
EUR/JPY	117.77	118.20	117.00
GBP/JPY	141.67	142.22	140.88
AUD/JPY	93.11	93.68	92.55
EUR/USD	1.3291	1.3316	1.3271

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	89.49	88.58
EUR/JPY	119.63	117.76
GBP/JPY	143.48	141.67
AUD/JPY	94.13	93.11
EUR/USD	1.3378	1.3291

*LD高安は東京クローズ~NYオープンまでの高安

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	89.91	90.13	89.23
EUR/JPY	120.28	120.58	119.01
GBP/JPY	143.84	144.24	142.54
AUD/JPY	94.80	95.01	93.98
NZD/JPY	75.67	75.82	74.91
EUR/USD	1.3380	1.3388	1.3335
AUD/USD	1.0545	1.0557	1.0524

米主要株	終値	前日比
米ダウ平均	13596.02	+84.79
S&P500	1480.93	+8.30
NASDAQ	3136.00	+18.46
その他主要株	終値	前日比
🇨🇦 トロント総合	12674.73	+65.91
🇧🇷 ボルサ指数	44943.34	+78.04
🇧🇷 ボベスバ指数	62194.06	+406.71

1/18 経済指標スケジュール

11:00	【中】12月鉱工業生産
11:00	【中】12月小売売上高
11:00	【中】4Q実質GDP
13:30	【日】11月鉱工業生産
13:30	【日】11月稼働率指数
18:30	【英】12月小売売上高指数
22:00	【ポーランド】11月経常収支
22:00	【ポーランド】11月貿易収支
22:30	【カナダ】11月製造業出荷
23:55	【米】1月ミシガン大学消費者信頼感指数
00:00	【メキシコ】政策金利発表

欧州主要株	終値	前日比
英FT100	6132.36	+28.38
仏CAC40	3744.11	+35.62
独DAX	7735.46	+44.33
ST欧州600	269.85	+2.11

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1690.80	+7.60
NY 原油	95.49	+1.25

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.26%	0.25%
3年債	0.39%	0.36%
5年債	0.79%	0.74%
7年債	1.28%	1.22%
10年債	1.88%	1.82%
30年債	3.07%	3.01%

(出所:ブルームバーグ)

NY 市場レポート

欧州市場

21:10

《米企業決算》

米 BOA

10-12 月期の一部除く 1 株当たり利益 0.29 ドル(予想 0.20 ドル)

米 ブラックロック

10-12 月期の調整後 1 株当たり利益 3.96 ドル(予想 3.73 ドル)

22:00

ドル/円 89.29 ユーロ/円 119.34 ユーロ/ドル 1.3368

22:00

欧州株式市場・米株価指数先物

欧州主要株価	株価	前日比	米株価先物	株価	前日比
英 FT100	6113.26	+9.28	ダウ INDEX FUTURE	13452	+15
仏 CAC40	3743.43	+34.94	S&P500 FUTURE	1468.70	+3.10
独 DAX	7689.46	-1.67	NASDAQ FUTURE	2733.75	+7.75

(出所:ブルームバーグ)

22:05

《米企業決算》

米 シティ

10-12 月期の 1 株当たり利益 0.38 ドル(予想 0.96 ドル)

22:30

《 経済指標の結果 》

新規失業保険申請件数 33.5 万件(予想 36.5 万件・前回 37.2 万件)

前回発表の 37.1 万件から 37.2 万件に修正

失業保険継続受給者数 321.4 万人(予想 315.0 万人・前回 312.7 万人)

前回発表の 310.9 万人から 312.7 万人に修正



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

《新規失業保険申請件数・継続受給者数》

申請件数・・・前週比・・・4 週移動平均・・・受給者数・・・受給者比率

13/01/12	335,000	-37,000	359,250	3,214,000	2.5%
13/01/05	372,000	+5,000	366,000	3,127,000	2.4%
12/12/29	367,000	+4,000	359,000	3,236,000	2.5%
12/12/22	362,000	+1,000	360,000	3,201,000	2.5%
12/12/15	362,000	+18,000	368,000	3,238,000	2.5%
12/12/08	344,000	-27,000	381,500	3,213,000	2.5%
12/12/01	371,000	-24,000	408,250		

受給者数は集計が 1 週間遅れる

《 経済指標の結果 》

12 月米住宅着工件数 95.4 万件(予想 89.0 万件・前回 85.1 万件)

前回発表の 86.1 万件から 85.1 万件に修正

12 月米住宅着工件数(前月比) 12.1%(予想 3.3%・前回 -4.3%)

前回発表の-3.0%から-4.3%に修正

12月米建設許可件数 90.3万件(予想 90.5万件・前回 90.0万件)

前回発表の 89.9万件から 90.0万件に修正

12月米建設許可件数(前月比) 0.3%(予想 0.5%・前回 3.7%)

前回発表の 3.6%から 3.7%に修正



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

《米住宅着工・許可件数》

12月・11月・10月・9月・8月・7月

住宅着工件数・・・95.4・85.1・88.9・84.3・75.0・72.8

一戸建て住宅・・・61.6・57.0・58.9・59.0・53.8・50.6

集合住宅・・・・・・33.8・28.1・30.0・25.3・21.2・22.2

許可件数・・・・・・90.3・90.0・86.8・89.0・80.1・81.1

一戸建て住宅・・・57.8・56.8・56.6・55.0・51.1・51.1

集合住宅・・・・・・32.5・33.2・30.2・34.0・29.0・30.0

前月比(%)

住宅着工・・・・・・12.1・・・4.3・・・ 5.5・・・12.4・・・ 3.0・・・-3.4
住宅建設許可・・・・ 0.3・・・ 3.7・・・-2.5・・・11.1・・・-1.2・・・ 6.7

《 経済指標の結果 》

11 月カナダ国際証券取扱高 56.2 億 CAD(予想 100.0 億 CAD・前回 126.7 億 CAD)前回発表の 132.6 億 CAD から 126.7 億 CAD に修正



(出所:ブルームバーグ)

《 NY 外国為替市場 序盤 》

序盤の外国為替市場は、序盤に発表された米雇用関連、住宅関連の経済指標がいずれも予想より改善したことを受けて、ドル円・クロス円は堅調な動きとなったものの、やや上値の重い展開となっている。

23:33

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	13556.68	+45.45
ナスダック	3130.89	+13.35

(出所:ブルームバーグ)

0:00

《 経済指標の結果 》

1 月フィラデルフィア連銀景況指数 -5.8(予想 6.0・前回 4.6)
前回発表の 8.1 から 4.6 に修正



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

《フィラデルフィア連銀指数》

	1月	12月	11月	10月	9月	8月
景況指数	-5.8	4.6	-8.9	4.2	-1.7	-9.1
仕入価格	14.7	23.5	27.9	20.6	15.4	15.7
新規受注	-4.3	4.97	-4.7	-0.5	2.5	-0.8
在庫水準	-6.5	-7.8	-9.6	-0.4	-19.8	-6.0
雇用者数	-5.2	-0.2	-6.9	-7.6	-4.9	-7.6

6ヵ月先の見通し

	1月	12月	11月	10月	9月	8月
景況指数	29.2	23.7	18.8	21.7	40.9	19.8
仕入価格	34.3	45.8	50.7	48.1	42.8	38.0
新規受注	32.5	28.3	23.2	22.6	52.0	25.3
在庫水準	-2.3	-2.5	1.9	-0.4	-1.6	-2.7
雇用者数	10.7	11.2	7.0	9.8	21.2	14.5

0:30

《 NY 株式市場 序盤 》

序盤の株式市場は、米商務省が発表した昨年12月の住宅着工件数が4年半ぶりの高水準だったことや、雇用関連指標が市場予想より良かったことを好感して堅調な展開で始まった。ただ、製造業関連の指標の悪化を受けてやや上値の重い動きとなっている。

《 経済指標のポイント 》

(1)米失業保険申請件数は、前週比-3.7万件的33.5万件的と、2008年1月19日までの週以来、約5年ぶりの低水準となった。申請件数の4週移動平均は前週比-6750人の35万9250人で、昨年12月29日までの週以来の低い水準となった。また、集計が1週遅れる失業保険受給者総数は、前週比+8.7万人の321.4万人と、昨年12月22日までの週以来の高水準となった。受給者総数の4週移動平均は、前週比-0.6万人の319万5750人で、2008年7月26日まで

の週以来、約 4 年半ぶりの低い水準だった。受給者比率は前週比 0.1 ポイント上昇の 2.5% だった。

(2) 米 2012 年 12 月の住宅着工件数は、年率換算で前月比+12.1%の 95.4 万件と前月の減少からプラスに転じ、件数ベースで 2008 年 6 月以来 4 年半ぶりの高水準となった。前年同月比も +36.9%の大幅な伸びとなった。主力の一戸建てとそれ以外の集合住宅などの着工件数がともに勢いがあつた。

- ①米経済は財政政策や雇用改善をめぐる先行き懸念が強いとされるが、住宅市場は FRB の低金利政策によって新築住宅販売が伸びているのにつれて着工件数も上昇基調を保っている。
- ②着工件数の先行指標である建設許可件数は、前月比+0.3%の 90.3 万件となり、件数ベースで 2008 年 7 月以来の高さだった。前年同月比は+28.8%。
- ③一戸建ては前月比+8.1%の 61.6 万件。それ以外の集合住宅などは+20.3%の 33.8 万件だった。
- ④地域別動向は、中西部が+24.7%、北東部が+21.4%、西部は+18.7%、最大市場の南部は+3.8%となった。
- ⑤2012 年の着工件数は、前年比+28.1%の 78 万件と 2008 年以来 4 年ぶりの高水準となった。許可件数も 81 万 3400 万件 4 年ぶりの高さだった。

(3) フィラデルフィア連銀製造業景況指数は、-5.8 となり前月の 4.6 から低下した。項目別では、新規受注は-4.3(前月 4.9)、出荷は 0.4(前月 14.7)、在庫水準は-6.5(前月-7.8)、また雇用者数は-5.2(前月-0.2)と 7 ヶ月連続でマイナスとなった。雇用の先行指標となる週平均労働時間は-8.3(前月 0.4)、仕入価格指数は 14.7(前月 23.5)。販売価格指数は-1.1(前月 12.4)。また、6 ヶ月先の景況指数は 29.2(前月 23.7)。同指数はゼロが拡大と縮小の境目を示す。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6132.36	+28.38
仏 CAC40	3744.11	+35.62
独 DAX	7735.46	+44.33
ストック欧州 600 指数	269.85	+2.11
ユーロファースト 300 指数	1165.54	+5.59
スペイン IBEX35 指数	8628.90	+47.80
イタリア FTSE MIB 指数	17587.35	+247.40
南ア アフリカ全株指数	39964.56	+84.80

(出所:ブルームバーグ)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、住宅や雇用関連の米指標が市場予想より良かったことや、スペインの国債入札が順調だったことで、投資家がリスク志向を強めたことから、主要株価は上昇した。英 FT100 は、2008 年 5 月以来、約 4 年 8 ヶ月ぶりの高値となった。



(出所:ブルームバーグ)

2:00

米主要株価・中盤

ダウ 13584.48(+73.25)、S&P500 1479.63(+7.00)、ナスダック 3133.97(+16.42)

《 NY 債券市場 ・午前 》

NY 債券市場は、米失業保険申請件数が約 5 年ぶりの低水準となる一方で、昨年 12 月の住宅着工件数が 4 年半ぶりの高水準に大きく改善したことから、景気の回復ペースが加速しているとの見方が強まって、安全資産とされる米国債の売りが先行した。

午前の利回りは、30 年債が 3.06% (前日 3.01%)、10 年債が 1.87% (1.82%)、7 年債が 1.27% (1.22%)、5 年債が 0.78% (0.74%)、3 年債が 0.38% (0.36%)、2 年債が 0.25% (0.25%)。

2:20

《 要人発言 》

アトランタ連銀総裁

- ・「量的緩和は 2013 年半ばを超えて継続へ」
- ・「金利政策は量的緩和と切り離してみるべきだ」
- ・「FRB バランスシートへの懸念は正当」
- ・「日本の失われた 10 年は米国ではない」
- ・「中国は軟着陸を果たしたと考えられる」

《ここまでの欧州のポイント》

- ① ECB は月報で、低金利と金融市場の安定を背景にユーロ圏経済が年内に緩やかに回復し始めるとの見通しを示した。月報は 10 日のドラギ総裁の会見内容を踏襲し、「インフレ圧力は引き続き抑制される」との見通しも示した。月報は、景気見通しへのリスクは依然として下向きだとした上で、「最近の幾つかの指標は総じて、低水準ながら安定し、金融市場の信頼感は大きく改善した」との認識を示し、「2013 年中に緩やかな回復が始まるだろう」と結論付けた。

- ②スペイン政府は国債入札を実施し、2015、2018、2041 年償還の国債、計 45 億 1000 万ユーロ(約 5370 億円)相当を発行した。発行高は目標上限に一致、落札利回りは前回入札時から低下した。15 年償還債の平均落札利回りは 2.713%(前回 3.358%)、応札倍率は 2.02 倍(前回 4.81 倍)。18 年償還債の落札利回りは 3.77%(前回 3.988%)、応札倍率は 2.32 倍(前回 2.59 倍)。41 年償還債は 5.696%(前回 5.893%)、応札倍率は 2.00 倍(前回 2.09 倍)となった。
- ③フランス政府は国債入札を実施し、計 79 億 8000 万ユーロ(約 9520 億円)相当を発行した。ユーロ圏崩壊の懸念後退で逃避需要が減ったことから、5 年債の落札利回りは前回入札時を上回った。5 年債(40 億 4500 万ユーロ)の平均落札利回りは 1.06%(前回 1.01%)だった。2 年債(23 億 5000 万ユーロ)の平均落札利回りは 0.24%だった。
- ④ドイツのショイブレ財務相は、ユーロ圏には問題が幾つか残っているものの、各国は債務危機への取り組みは徐々に進展しているとの見解を示した。ドイツ議会で、金融市場のユーロ圏への信頼は戻りつつあり、これは国債スプレッドに反映されていると語った。また、野党・社会民主党の首相候補であるシュタインブ リュック前財務相が債務危機の責任がもっぱら銀行にあると議会で非難したことについて、ショイブレ財務相は根拠がないと発言した。

4:30

NY 金は、中心限月が前日比 7.60ドル高の 1 オンス=1690.80ドルで取引を終了した。

5:15

NY 原油は、中心限月が前日比 1.25ドル高の 1 バレル=95.49ドルで取引を終了した。

コモディティー	終 値	前日比
NY GOLD	1690.80	+7.60
NY 原油	95.49	+1.25

(出所:ブルームバーグ)

《 NY 金市場 》

NY金は、雇用や住宅関連の米経済指標が市場予想より良い内容だったことから、FRB による金融緩和の継続観測が後退して売りが先行したが、その後は米国株や原油先物の上昇につれて投資家心理が改善し、買い戻しが広がった。終値ベースでは、昨年 12 月 17 日以来、1 カ月ぶりの高値水準となった。



(出所:ブルームバーグ)

《 NY 原油市場 》

NY原油は、雇用や住宅関連の米経済指標の改善を受けて景気回復への期待感が強まり、買いが膨らんだ。ドルがユーロなどに対して下落し、ドル建ての原油先物に割安感が出たことも支援材料となった。終値ベースでは昨年9月中旬以来、約4ヵ月ぶりの高値水準となった。



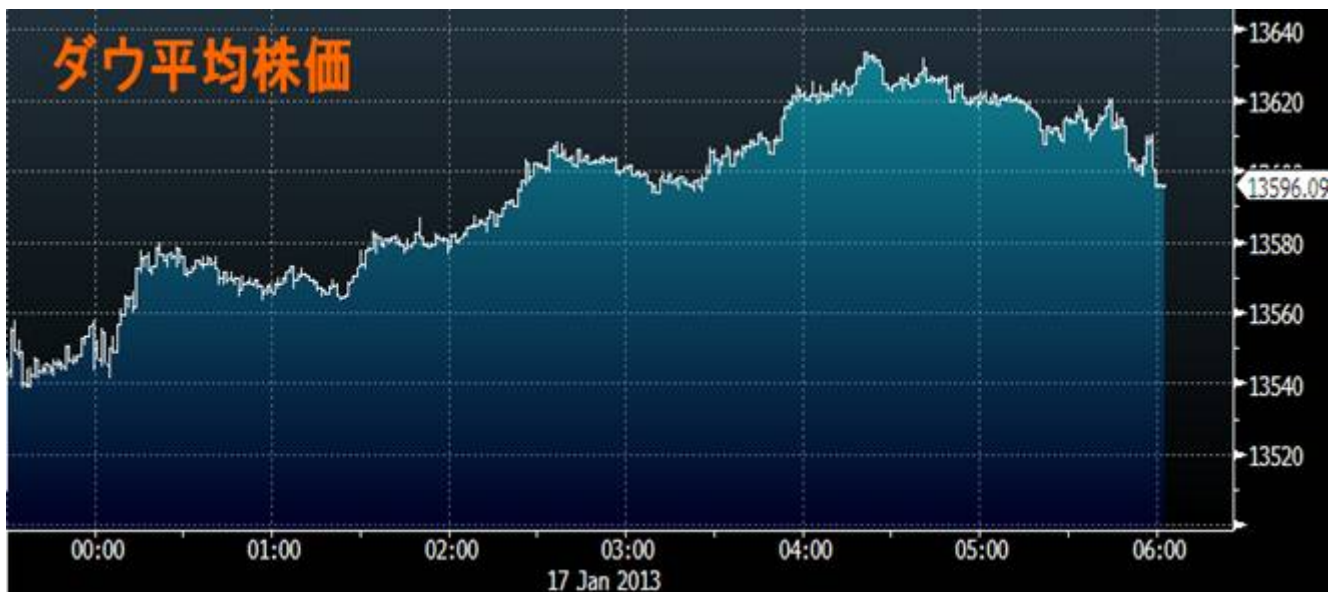
(出所:ブルームバーグ)

米主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	13596.02	+84.79	13633.89	13510.24
S&P500 種	1480.93	+8.30	1485.16	1472.63
ナスダック	3136.00	+18.46	3144.04	3125.79

(出所:ブルームバーグ)

《米株式市場》

米株式市場は、米住宅着工件数が4年半ぶりの高水準だったことや、雇用関連指標が5年ぶりの低水準となったことを好感して、主要株価は堅調な展開で始まった。ただ、その後に発表された米製造業関連の指標の悪化を受けてやや上値の重い動きも見られたものの、終盤まで堅調な展開が続いた。ダウ平均株価は、序盤から堅調な展開が続き、終盤には一時前日比122ドル高まで上昇する動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	89.91	90.13	89.23
EUR/JPY	120.28	120.58	119.01
GBP/JPY	143.84	144.24	142.54
AUD/JPY	94.80	95.01	93.98
NZD/JPY	75.67	75.82	74.91
EUR/USD	1.3380	1.3388	1.3335
AUD/USD	1.0545	1.0557	1.0524

(出所:ブルームバーグ)

《外国為替市場》

外国為替市場は、米国の雇用関連、住宅関連の経済指標が好調な結果となったことから、ドル買い・円売りが優勢となり、また投資家のリスク志向の動きも強まり、終盤にかけてドル円・クロス円は堅調な動きが続いた。特に、ドル/円は一時 2010 年 6 月 23 日以来の 90 円台に乗せる場面もあった。また、ユーロ/円は 2011 年 5 月 4 日以来の高値を更新する動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)

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ご自身でお願いします。