

NY マーケットレポート (2013 年 11 月 6 日)

昨晚の NY 外国為替市場は、主要な米国の経済指標の発表がないことから、取引材料に乏しく、ドル円・クロス円は小動きの展開で始まりました。その後、ユーロ圏のサービス業景況指数が速報値から上方修正されたことを背景に、ECB が理事会で利下げを見送るとの観測が強まったことから、ユーロが主要通貨に対して上昇する動きとなりました。また、株価が堅調な動きとなったことから、安全資産とされる円を売る動きが強まる場面もありました。しかし、ECB 理事会、米 GDP、米雇用統計を控えて様子見ムードも強く、午後に入るとドル円・クロス円は小動きの展開が続きました。

2013/11/ 6 (水)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	98.57	98.76	98.41
EUR/JPY	133.10	133.45	132.55
GBP/JPY	158.42	158.92	157.93
AUD/JPY	93.76	94.04	93.39
EUR/USD	1.3504	1.3522	1.3467

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	98.69	98.48
EUR/JPY	133.43	132.86
GBP/JPY	158.90	158.28
AUD/JPY	94.05	93.65
EUR/USD	1.3533	1.3489

*LD高安は東京クローズ～NYオープンまでの高安

アジア主要株価	終値	前日比
日経平均	14337.31	+111.94
ハンセン指数	23036.94	-2.01
上海総合	2139.61	-17.63
韓国総合指数	2013.67	-0.26
豪ASX200	5433.81	+1.84
インドSENSEX指数	20894.94	-79.85
シンガポールST指数	3205.29	-0.25

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6741.69	-5.15
仏CAC40	4286.93	+33.59
独DAX	6040.87	+31.76
ST欧州600	323.26	+1.37
西IBEX35指数	9837.10	+41.40
伊FTSE MIB指数	19262.51	+170.58
南ア 全株指数	46192.91	+442.68

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	98.69	98.74	98.59
EUR/JPY	133.39	133.72	133.15
GBP/JPY	158.68	159.00	158.50
AUD/JPY	94.01	94.16	93.81
NZD/JPY	82.69	83.04	82.60
EUR/USD	1.3518	1.3548	1.3502
AUD/USD	0.9527	0.9539	0.9511

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	15746.88	+128.66
S&P500	1770.49	+7.52
NASDAQ	3931.95	-7.92
その他主要株	終値	前日比
カナダトロント総合	13380.41	+18.70
ブラジルボルサ指数	10280.09	-24.36
ボネバ指数	53384.60	-447.25

11/7 経済指標スケジュール

09:30	【豪】10月失業率
09:30	【豪】10月雇用者数
09:30	【豪】10月労働参加率
14:00	【日】9月景気一致CI指数
14:00	【日】9月景気先行CI指数
15:00	【南ア】10月外貨準備高
15:45	【スイス】10月SECO消費者信頼感指数
17:30	【スウェーデン】10月財政収支
18:00	【ノルウェー】9月鉱工業生産
20:00	【独】9月鉱工業生産
20:00	【南ア】9月製造業生産
21:00	【英】政策金利発表
21:45	【欧】政策金利発表
22:30	【米】新規失業保険申請件数
22:30	【米】失業保険継続受給者数
22:30	【米】3Q GDP
22:30	【米】3Q個人消費
23:00	【メキシコ】消費者物価指数
05:00	【米】9月消費者信用残高

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1317.80	+9.70
NY 原油	94.80	+1.43
CMEコーン	421.25	-3.75
CBOT 大豆	1263.00	+3.75

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.29%	0.30%
3年債	0.55%	0.58%
5年債	1.34%	1.38%
7年債	2.01%	2.05%
10年債	2.64%	2.66%
30年債	3.77%	3.76%

11/7 主要会議・講演・その他予定

・ECB総裁定例会見

(出所: SBILM)

NY 市場レポート

欧州市場

21:00

《 経済指標の結果 》

米 MBA 住宅ローン申請指数(前週比) -7.0%(前回 6.4%)



(出所:ブルームバーグ)

指標結果データ

《MBA 住宅ローン申請指数》

11/1・10/25・10/18・10/11・10/4・前年

申請指数-7.0・ 6.4・-0.6・ 0.3・ 1.3・-41.5

購入-5.2・ 2.3・ 0.7・ -4.8・-0.7・-0.9

借換え-7.9・ 8.7・-1.3・ 3.3・ 2.5・-52.0

固定金利-7.1・ 6.4・-0.8・ 0.3・ 1.0・-43.2

変動金利 (ARM)・-6.3・ 6.4・ 2.0・ -0.5・ 6.0・ 4.0

ローン契約平均金利

固定金利 30 年・・・4.32・・・4.33・・・4.39・・・4.46・・・4.42

固定金利 15 年・・・3.44・・・3.42・・・3.51・・・3.53・・・3.52

【MBA 住宅ローン申請件数】

MBA 住宅ローン申請件数とは、米抵当銀行協会(Mortgage Bankers Association)が毎週発表する個人の住宅ローン申請件数を指数化した指標である。購入、借換え、固定・変動金利のローン申請件数などの数値を基にした指数である。

21:30

《 経済指標の結果 》

10 月米チャレンジャー人員削減数(前年比) -4.2%(前回 19.1%)



(出所:ブルームバーグ)

指標結果データ

《チャレンジャー人員削減数》

10 月・・・9 月・・・8 月・・・7 月・・・6 月・・・5 月

合計・・・45,730・・・40,289・・・50,462・・・37,701・・・39,372・・・36,398

増減・・・5,441・・・-10,173・・・12,761・・・-1,671・・・2,974・・・-1,723

前年比・・・-4.2・・・19.1・・・56.5・・・2.3・・・4.8・・・-41.2

東部・・・24,280・・・6,986・・・7,741・・・12,069・・・20,398・・・7,068

中西部・・・4,820・・・9,066・・・21,926・・・8,373・・・4,750・・・13,080

西部・・・6,953・・・16,194・・・12,940・・・8,929・・・8,392・・・9,894

南部・・・9,677・・・8,043・・・7,855・・・8,330・・・5,832・・・6,356

【チャレンジャー人員削減数】

チャレンジャー人員削減数は、雇用コンサルティング会社のチャレンジャー社が発表する指標で、解雇など人員削減者数を測る指標。米国企業の人員削減数が前年より増加したか、減少したかを判断する指標となり、通常時は注目度がやや低いものの、雇用情勢の変化を見極める場面では注目されている。

22:00

ドル/円 98.61 ユーロ/円 133.32 ユーロ/ドル 1.3521

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	6755.27	+8.43	ダウ INDEX FUTURE	15617	+67
仏 CAC40	4291.46	+38.12	S&P500 FUTURE	1765.30	+8.80
独 DAX	9046.07	+36.96	NASDAQ FUTURE	3393.75	+14.00

(出所: SBILM)

22:30

《 経済指標の結果 》

9月カナダ住宅建設許可(前月比) 1.7%(予想 6.0%・前回 -20.0%) 前回発表の-21.2%から 20.0%に修正



(出所:ブルームバーグ)

22:32

米財務省

- ・「100億-150億ドル規模の変動利付債を初めて入札へ」
- ・「2014年1月29日に初の変動利付債入札へ」

米財務省は2014年1月29日に100億-150億ドル相当の変動利付債を発行すると発表した。新たな形式の国債発行は17年ぶり、償還期間は2年となる。財務省は予算をめぐる議会での対立を理由に、10-12月期の入札規模を維持する方針も示した。

《 NY 外国為替市場 序盤 》

序盤の外国為替市場は、このところ発表された米経済指標の改善を受けて米量的金融緩和策が長期化するとの見方が後退し、円を売り、ドルを買う動きが先行した。ただ、ECB理事会や、米雇用統計の発表を控えて様子見ムードが強く、比較的小動きの展開が続いている。

23 : 33

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	15673.80	+55.58
ナスダック	3952.51	+12.65

(出所:SBILM)

0 : 00

《 経済指標の結果 》

9月米景気先行指標総合指数（前月比） 0.7%（予想 0.6%・前回 0.7%）



(出所:ブルームバーグ)

指標結果データ

《米景気先行指数》

	9月	8月	7月	6月	5月	4月	3月
先行指数	0.7	0.7	0.4	0.0	0.2	0.8	-0.3
一致指数	0.2	0.3	0.0	0.1	0.3	0.2	0.2
遅行指数	0.6	0.3	-0.1	0.2	0.3	0.2	0.0

【景気先行指標総合指数】

景気先行指標総合指数は、複数の経済指標を組み合わせる算出し、景気の先行きや方向性などを総合的に判断する経済指標である。

《 経済指標の結果 》

10 月英 NIESR GDP 予想 0.7% (前回 0.8%)



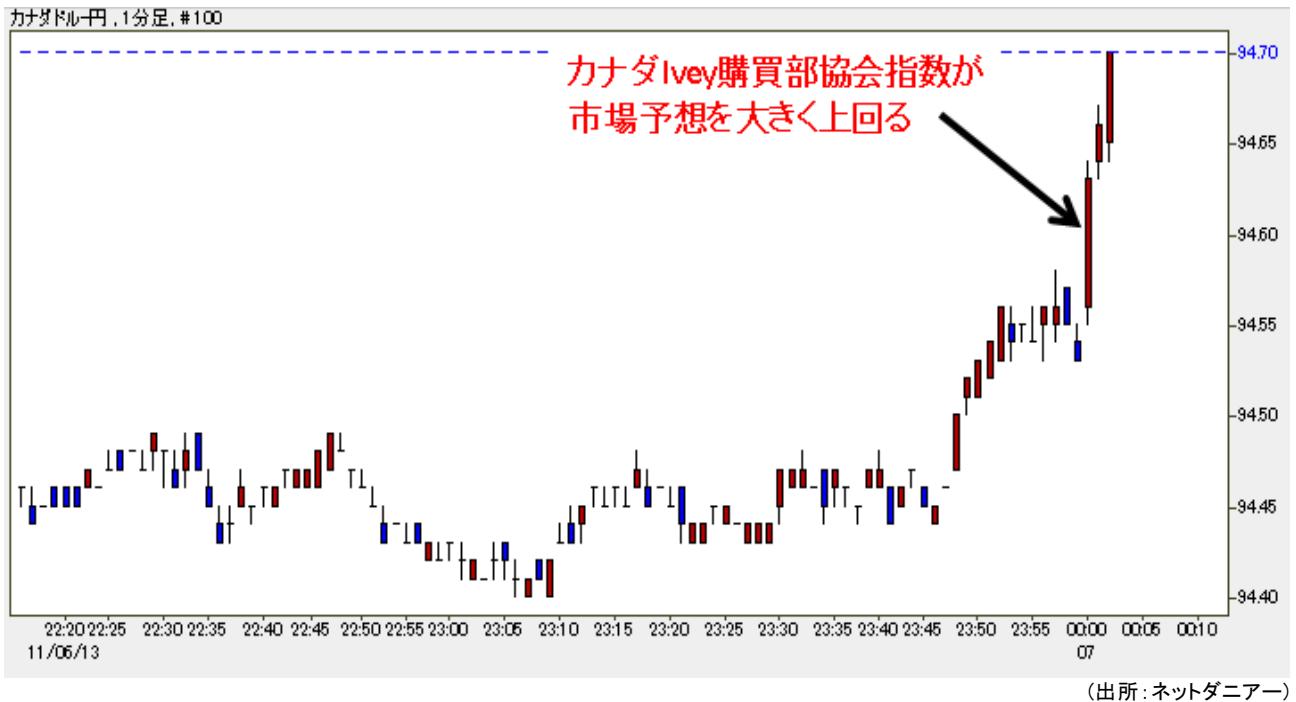
(出所:ブルームバーグ)

《 経済指標の結果 》

10月カナダIvey購買部協会指数 62.8 (予想 52.0・前回 51.9)



(出所:ブルームバーグ)



0 : 30

《EIA 米週間在庫統計》

原油在庫・・・158 万バレル増加
ガソリン在庫・・・376 万バレル減少
留出油在庫・・・490 万バレル減少

《海外の話題》

米ニューヨーク市で、任期満了に伴う市長選の投開票が行われた。複数の米主要メディアによると、民主党の市政監督官ビル・デブラシオ氏（52）が、共和党の元副市長ジョー・ロタ氏（59）らを破り、初当選を確実にした。

同市長選での民主党候補の勝利は1989年以来、24年ぶり。来年1月1日に市長に就任する。任期は4年。貧富の格差が広がった点を焦点とし、年収50万ドル（約4930万円）以上の富裕層への増税など、リベラル色の強い政策を掲げた。出口調査によると、黒人の96%、ヒスパニックの85%が同氏を支持した模様。

0 : 40

《 NY 株式市場 序盤》

序盤の株式市場は、欧州の主要市場で株価が上昇したことなどが好感され、米主要株価も買いが優勢となった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前日比で114ドル高まで上昇し、最高値を更新する動きとなった。

《 経済指標のポイント 》

(1) MBA（全米抵当貸付銀行協会）の住宅ローン申請指数は、前週比-7.0%となり、9月半ば以来の低水準に低下した。購入意欲は年初来で最低となったことが要因となった。

①構成指数の購入指数は-5.2%と昨年 12 月以来の低水準となり、借り換え指数も-7.9%となった。借り換え指数は、前週に約 3 ヶ月ぶりの高水準に達していた。

②30 年固定金利型の住宅ローン金利は 4.32%（前週 4.33%）と、6 月半ば以来の低水準となった。また、15 年固定金利型は 3.44%（前週 3.42%）と上昇した。

③申請件数全体に占める借り換えの割合は、前週は約 4 ヶ月ぶりの高水準となったものの、66.1%（66.5%）に低下した。

(2) 米景気先行指数は、+0.7%となり、市場予想の+0.6%を上回り、前月と同じとなった。一致指数は、伸び幅が縮小したものの、遅行指数が伸び幅を拡大して全体を押し上げた。

《ポイント》

NAR（全米不動産業者協会）が発表したりポートによると、米一戸建ての平均取引価格が前年から上昇したのは 163 都市圏のうち 144 となった。3 分の 1 の地域で 2 ケタの伸びを示した。

住宅価格持ち直しの傾向は全米に見られ、売却希望物件の供給が イトな上、価格を押し下げてきた差し押さえ物件売却の割合が低下したことが寄与している。販売に対する在庫比率は第 3 四半期に 5 ヶ月と、1 年前の 5.9 ヶ月から低下した。

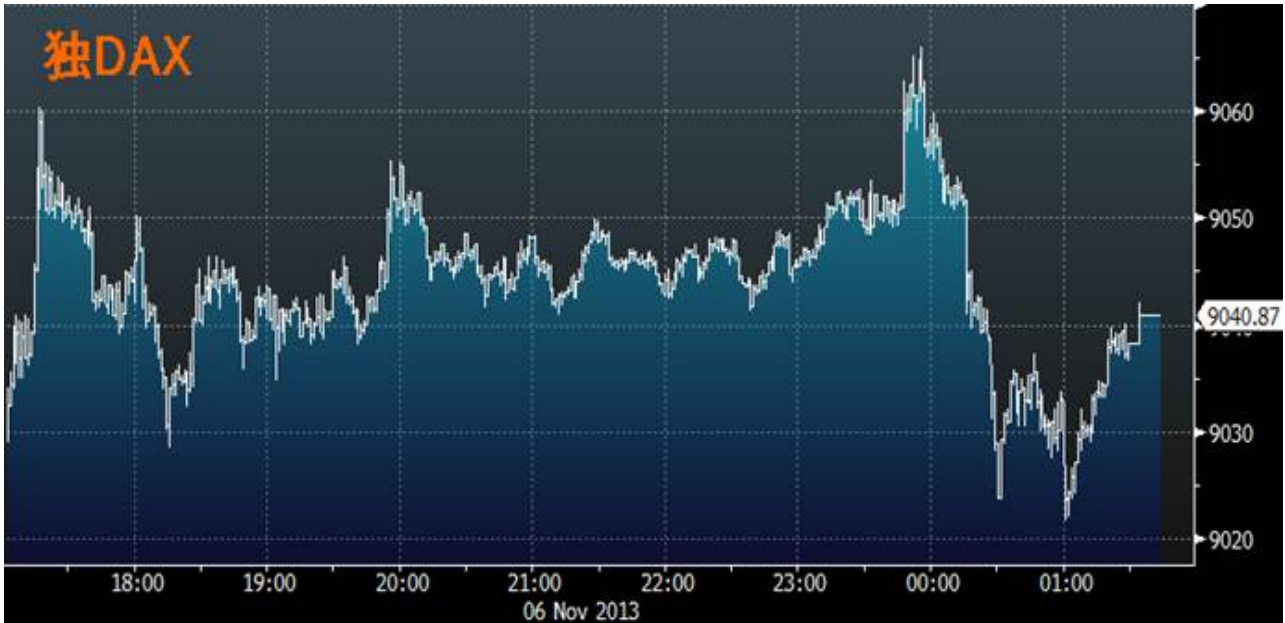
一部の価格上昇は持続不可能な水準に近づいていると指摘。カリフォルニア州沿岸部の大半は 20%を超える過大評価になっているとの見解を示した。全米の一戸建て中古住宅価格の中央値は、第 3 四半期に 20 万 7300 ドル（約 2046 万円）と、1 年前に比べ 12.5% 上昇した。

欧州主要株	終値	前日比
英 FT100	6741.69	-5.15
仏 CAC40	4286.93	+33.59
独 DAX	6040.87	+31.76
ストック欧州 600 指数	323.26	+1.37
ユーロファースト 300 指数	1296.58	+5.00
スペイン IEX35 指数	9837.10	+41.40
イタリア FTSE MIB 指数	19262.51	+170.58
南ア アフリカ全株指数	46192.91	+442.68

(出所: SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、ECB 理事会などを控えて様子見ムードも強く、主要株価はまちまちの結果となった。独 DAX は経済指標の改善が支援材料となり小幅高となったものの、英 FT100 は方向感に乏しい展開となり小幅安となった。



(出所:ブルームバーグ)

2 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 15703.08 (+84.86)、S&P500 1766.89 (+3.92) ナスダック 3930.09 (-9.78)

《NY 債券市場・午前》

午前の債券市場は、新規の手掛かり材料に乏しい中、米金融緩和の長期継続観測が根強く、米国債の買いがやや先行した。ただ、7-9 月期の米 GDP や 10 月の雇用統計の発表を控えて様子見ムードも広がり、小動きの展開が続いている。

午前の利回りは、30 年債が 3.78% (前日 3.77%)、10 年債が 2.65% (2.67%)、7 年債が 2.02% (2.06%)、5 年債が 1.34% (1.38%)、3 年債が 0.55% (0.58%)、2 年債が 0.30% (0.30%)。

《欧州のポイント》

①イタリアの上院は、脱税の罪で実刑判決が確定したベルルスコーニ元首相の議員資格剥奪の是非を問う採決を今月 27 日に行うことを決めた。採決は記名式で行われる。レッタ首相率いる中道左派・民主党は賛成する見通し。このため、元首相の中道右派政党・自由の人民は連立離脱も辞さないと警告している。

②独経済技術省が発表した 9 月の製造業受注指数は、前月比+3.3%となり、予想を上回る伸びとなった。ユーロ圏の景気回復と国内の投資拡大が追い風となった。また、前年同月比では+7.9%となった。同指標の 8 月の指数は前月比-0.3%、前年同月比では+3.1%だった。

③10月の英住宅価格の平均は、前月比+0.7%の17万1991ポンド（約2730万円）となり、前年同月比では+8.1%となった。低金利と景気回復を追い風に9ヵ月連続で値上がりしている。ハリファクスは、低金利に加え、持続的な景気回復の兆候が増えていることで高まった消費者信頼感が住宅需要拡大に寄与していると指摘、市況改善に反応して売却意欲も最近数ヵ月に改善しており、向こう数ヵ月の物件増加につながると付け加えた。

④英政府統計局が発表した9月の鉱工業生産指数は、前月比+0.9%となり、前月落ち込んだ製造業生産の持ち直しが寄与した。また、9月の製造業生産指数は、前月比+1.2%となり、これも事前予想を上回る結果となった。

⑤欧州委員会は、前日公表した経済見通しで、英国の成長率予想を上方修正し、見通しが著しく改善したと指摘した。7-9月期の英GDPは前期比+0.8%だった。マークイット・エコノミクスは、10月の業界調査は10-12月期初めの成長加速を示していると指摘した。英経済に関して最近続いている報が企業と消費者の信頼感を一段と高め、これが持続的な需要の高まりにつながることを製造業は期待するようになるとの指摘も出ている。

3:15

《 要人発言 》

ピアナルト・クリーブランド連銀総裁～講演

- ・「緩和縮小は金融引き締めではない」
- ・「米労働市場に意味ある進展」
- ・「住宅は引き続き米経済を抑制している」
- ・「FOMCは資産購入で慎重になるべき」

3:20

NY金は、中心限月が前日比9.70高の1オンス=1317.80ドルで取引を終了した。

5:20

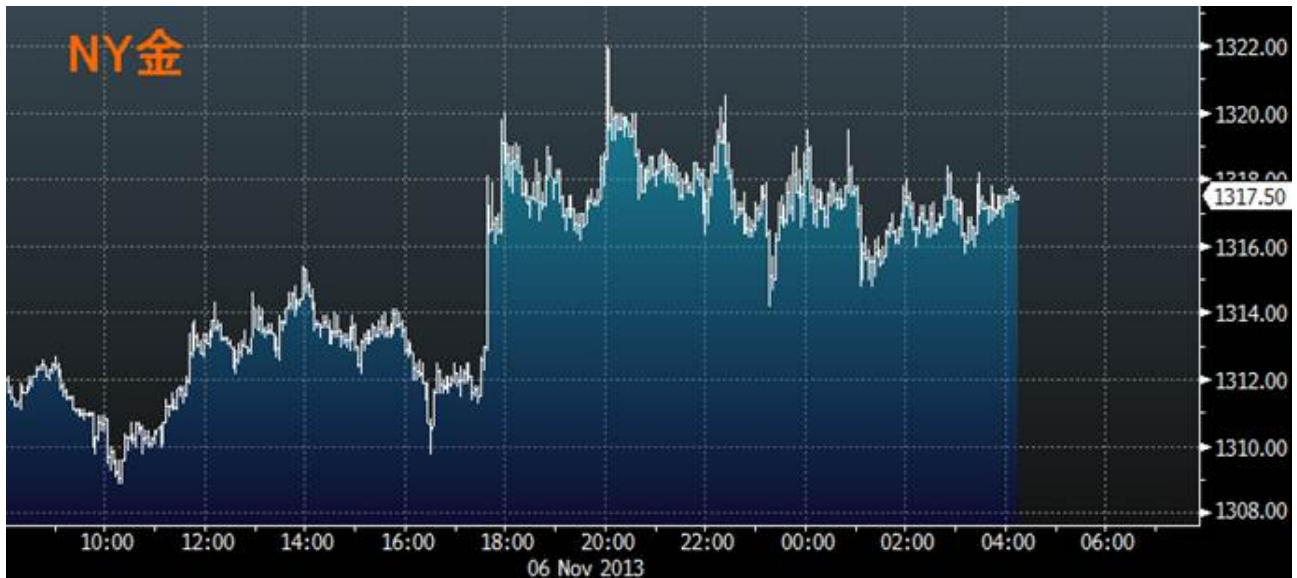
NY原油は、中心限月が前日比1.43ドル高の1バレル=94.80ドルで取引を終了した。

要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1317.80	+9.70
NY 原油	94.80	+1.43

(出所:SBILM)

《 NY 金市場 》

NY金は、ECB の利下げ観測が後退しユーロ高・ドル安が進んだため、ドル建て取引の割安感から買いが先行した。ただ、10月の米雇用統計の内容を見極めたいとの思惑も強く、上値は限定的だった。



(出所:ブルームバーグ)

《 NY 原油市場 》

NY原油は、米石油統計で、ガソリンや石油精製品の在庫が市場予想より大幅に減少したため、エネルギー需要の増加期待から買いが優勢となった。



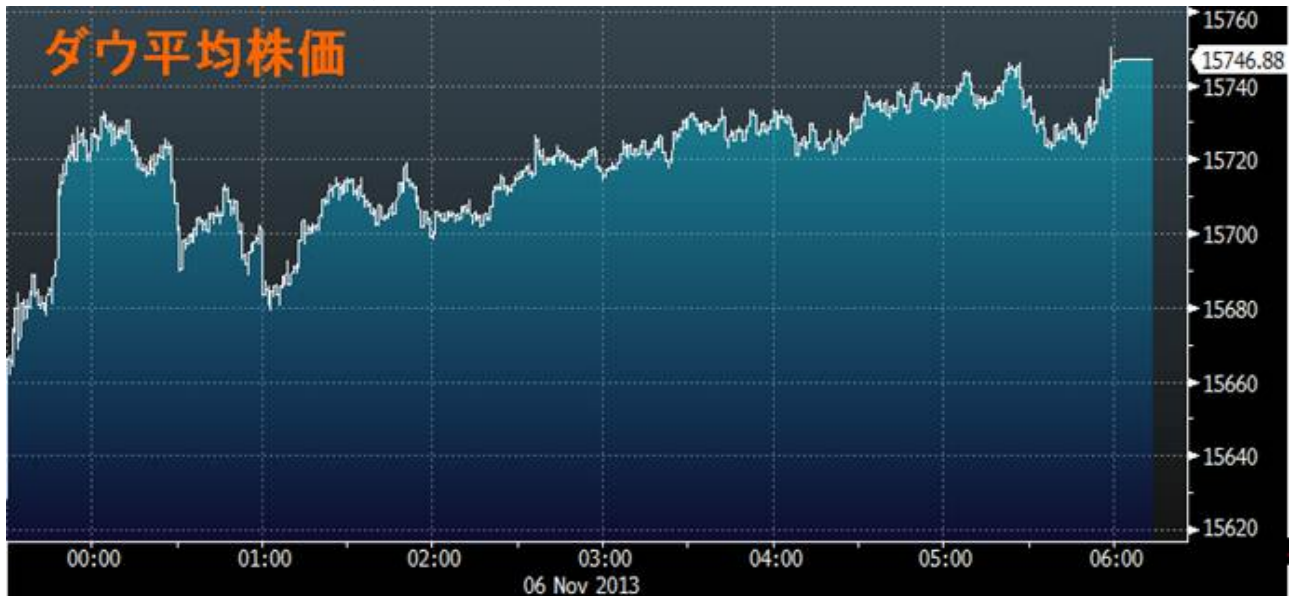
(出所:ブルームバーグ)

米主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	15746.88	+128.66	15750.29	15628.72
S&P500 種	1770.49	+7.52	1773.74	1764.40
ナスダック	3931.95	-7.92	3955.97	3920.91

(出所:SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、欧州の主要市場で株価が上昇したことなどが好感され、米主要株価も買いが優勢となった。その後、ナスダックはマイナス圏まで下落したものの、ダウ平均、S&P500 は堅調な展開が続いた。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、終盤に一時前日比で 132 ドル高まで上昇し、最高値を更新する場面もあった。



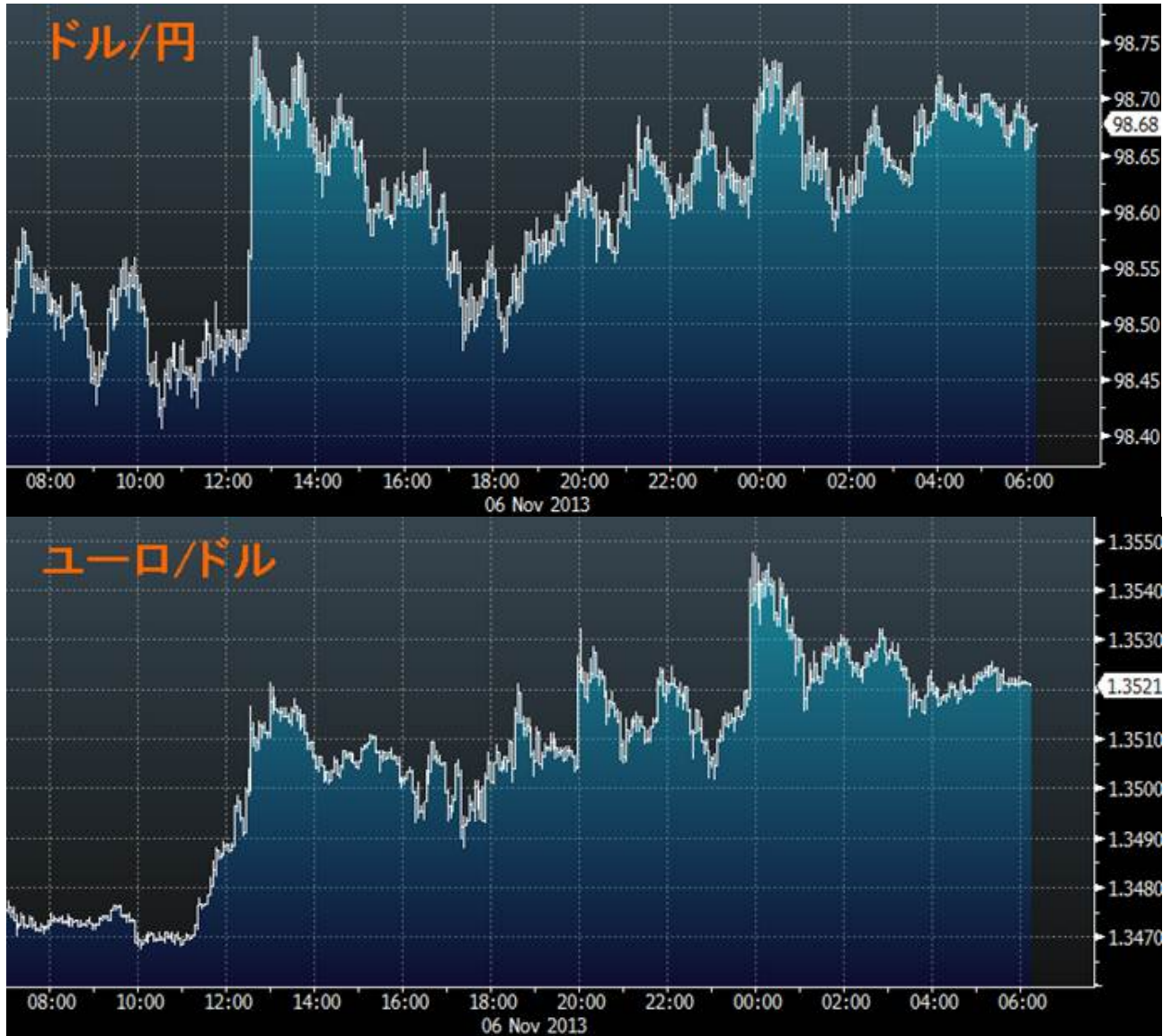
(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	98.69	98.74	98.59
EUR/JPY	133.39	133.72	133.15
GBP/JPY	158.68	159.00	158.50
AUD/JPY	94.01	94.16	93.81
NZD/JPY	82.69	83.04	82.60
EUR/USD	1.3518	1.3548	1.3502
AUD/USD	0.9527	0.9539	0.9511

(出所:SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、主要な経済指標の発表がなく、取引材料に乏しい中、ドル円・クロス円は序盤から小動きの展開となった。しかし、ECB の利下げ観測が後退したとの見方が広がったことから、ユーロが主要通貨に対して上昇する動きとなった。また、株価が堅調な動きとなったことから、円が主要通貨に対して軟調な動きとなった。しかし、ECB 理事会や米雇用統計を控えて様子見気分も強く、午後には小動きの展開が続いた。



(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。