

NYマーケットレポート（2014年10月1日）

NY市場では、序盤に発表されたADP雇用統計が市場予想を上回ったが、米長期債利回りが低下したことや、その後に発表された製造業、建設関連の米経済指標が悪化したことから、ドル売り・円買いが優勢となった。また、欧米の株価が大きく下落したことを受けて、投資家のリスク回避の動きが強まったことから、安全資産とされる円を買う動きが優勢となり、ドル円・クロス円は終盤まで軟調な展開が続いた。また、一部では、米国内で初めてエボラ出血熱の感染が確認されたことから、経済活動が停滞するとの懸念も、株売り・ドル売りの一因の話も出ていた。

2014/10/1 (水)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	109.86	110.09	109.56
EUR/JPY	138.37	138.80	138.35
GBP/JPY	177.99	178.14	177.65
AUD/JPY	95.50	95.95	95.23
EUR/USD	1.2597	1.2633	1.2593

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	109.94	109.70
EUR/JPY	138.49	138.18
GBP/JPY	177.98	177.54
AUD/JPY	95.84	95.45
EUR/USD	1.2617	1.2585

*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	16082.25	-91.27
ハンセン指数	休場	
上海総合	休場	
韓国総合指数	1991.54	-28.55
豪ASX200	5334.13	+41.32
インドSENSEX指数	26567.99	-62.52
シンガポールST指数	3264.09	-12.65

*中国市場は国慶節のため休場

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6557.52	-65.20
仏CAC40	4365.27	-50.97
独DAX	9382.03	-92.27
ST欧州600	340.22	-2.86
西IBEX35指数	10753.20	-72.30
伊FTSE MIB指数	20706.31	-185.80
南ア 全株指数	48875.03	-461.28

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	109.01	109.99	108.90
EUR/JPY	137.53	138.55	137.40
GBP/JPY	176.37	178.05	176.19
AUD/JPY	95.20	95.67	95.10
NZD/JPY	84.83	85.91	84.71
EUR/USD	1.2618	1.2640	1.2583
AUD/USD	0.8734	0.8748	0.8689

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	16804.71	-238.19
S&P500	1946.16	-26.13
NASDAQ	4422.09	-71.30
その他主要株	終値	前日比
カナ トロント総合	14805.44	-155.07
ブラ ボルサ指数	44364.96	-620.70
メキシコ ボベスパ指数	52858.43	-1257.55

10/2 経済指標スケジュール

08:50	【日】9月マネタリーベース
09:00	【NZ】9月ANZ商品価格指数
10:00	【豪】8月HIA新築住宅販売
10:30	【豪】8月住宅建設許可件数
10:30	【豪】8月貿易収支
17:30	【英】9月建設業PMI
18:00	【欧】8月生産者物価指数
19:00	【南ア】3Q BER消費者信頼感
20:30	【米】10月RBC消費者予測指数
20:30	【米】9月チャレンジャー人員削減数
20:45	【欧】欧州政策金利発表
21:30	【米】新規失業保険申請件数
21:30	【米】失業保険継続受給者数
23:00	【米】8月製造業受注指数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1215.50	+3.90
NY 原油	90.73	-0.43
CMEコーン	321.25	+0.50
CBOT 大豆	916.75	+3.50

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.52%	0.58%
3年債	0.97%	1.05%
5年債	1.68%	1.77%
7年債	2.10%	2.22%
10年債	2.39%	2.50%
30年債	3.10%	3.21%

10/2 主要会議・講演・その他予定

- ・ドラギECB総裁 定例会見
- ・米アトランタ連銀総裁 講演

(出所: SBILM)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 108.92 ユーロ/円 138.43 ユーロ/ドル 1.2595

21:00

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	6583.86	-38.86	ダウ INDEX FUTURE	16937	-28
仏 CAC40	4390.54	-25.70	S&P500 FUTURE	1961.00	-4.50
独 DAX	9460.51	-13.70	NASDAQ FUTURE	4032.75	-12.00

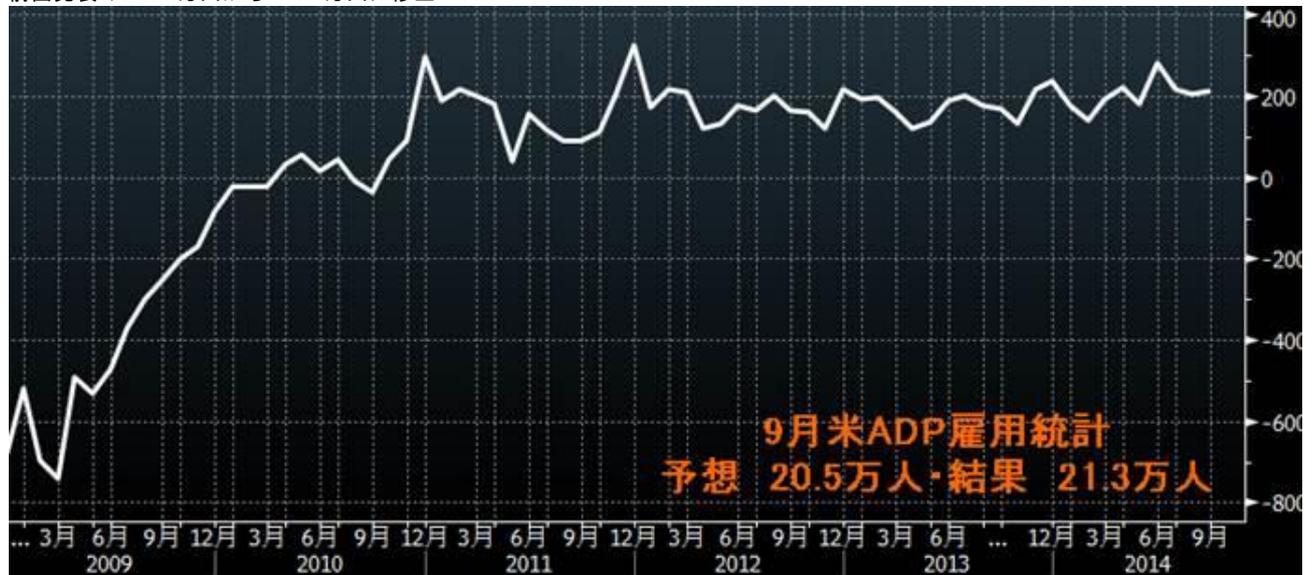
(出所:SBILM)

21:15

◀ 経済指標の結果 ▶

9月米ADP雇用統計 21.3万人(予想 20.5万人・前回 20.2万人)

前回発表の20.4万人から20.2万人に修正



(出所:ブルームバーグ)

指標結果データ
 << ADP 雇用統計 >>

9月・8月・7月・6月・5月・4月・3月
 ADP 雇用者数 (前月比) ・ ・ ・ 21.3 ・ ・ 20.2 ・ ・ 21.2 ・ ・ 28.1 ・ ・ 17.5 ・ ・ 21.5 ・ ・ 19.8
 (万人)



(出所: ネットダニアー)

22:00

IMF が世界金融安定報告の一部を公表

- ・ 「新興市場の『影の銀行』は約 7 兆ドルと推計」
- ・ 「中国の『影の銀行』には緊密な監視が必要」
- ・ 「日本の『影の銀行』は推計 2.5 兆-6 兆ドル」
- ・ 「各国に『影の銀行』の監視強化を呼び掛け」
- ・ 「米国の『影の銀行』は推計 15 兆-25 兆ドル」
- ・ 「ユーロ圏の『影の銀行』は推計 13.5 兆-22.5 兆ドル」

22:30

<< 経済指標の結果 >>

9月シンガポール購買部景気指数 50.5 (予想 49.9・前回 49.7)

9月シンガポール電子産業指数 51.9 (予想 50.6・前回 50.7)



(出所: ブルームバーグ)



(出所:ブルームバーグ)

22 : 33

米主要株価

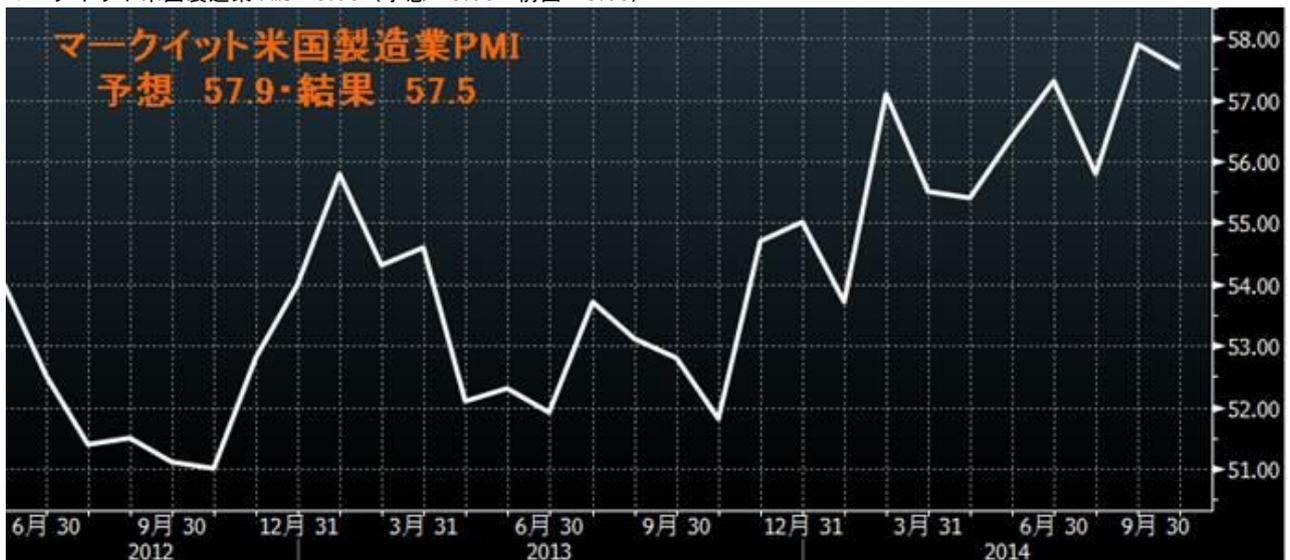
米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17011.43	-31.47
ナスダック	4481.45	-11.94

(出所:SBILM)

22 : 45

◀ 経済指標の結果 ▶

マークイット米国製造業PMI 57.5 (予想 57.9・前回 57.9)



(出所:ブルームバーグ)

23:00

◀ 経済指標の結果 ▶

9月米ISM製造業景況指数 56.6 (予想 58.5・前回 59.0)



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

◀ 米 ISM 製造業景況指数 ▶

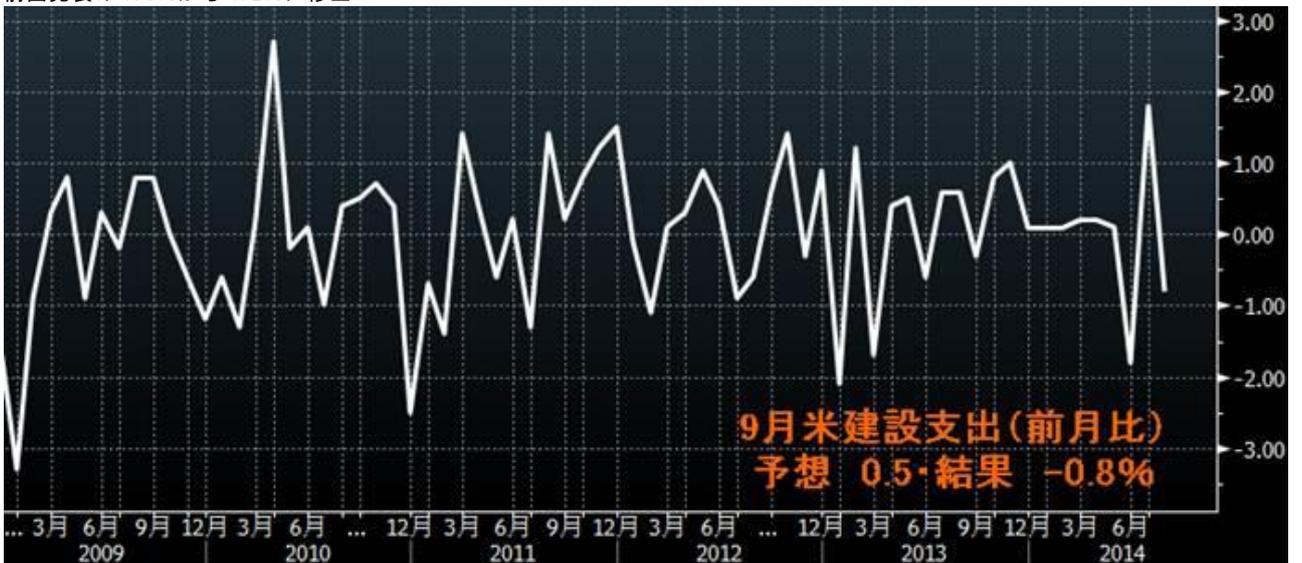
	9月	8月	7月	6月	5月	4月	3月
景気	56.6	59.0	57.1	55.3	55.4	54.9	53.7
価格	59.5	58.0	59.5	58.0	60.0	56.5	59.0
生産	64.6	64.5	61.2	60.0	61.0	55.7	55.9
新規受注	60.0	66.7	63.4	58.9	56.9	55.1	55.1
受注残	47.0	52.5	49.5	48.0	52.5	55.5	57.5
入荷遅延	52.2	53.9	54.1	51.9	53.2	55.9	54.0
在庫	51.5	52.0	48.5	53.0	53.0	53.0	52.5
雇用	54.6	58.1	58.2	52.8	52.8	54.7	51.1

23:00

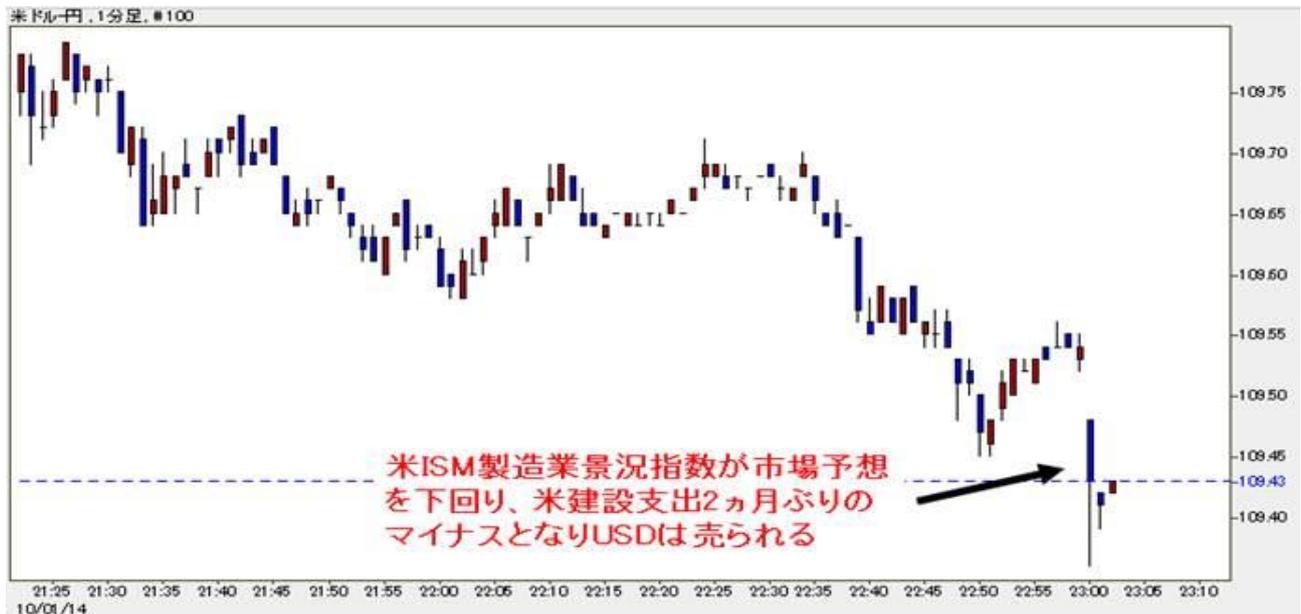
◀ 経済指標の結果 ▶

9月米建設支出(前月比) -0.8% (予想 0.5%・前回 1.2%)

前回発表の1.8%から1.2%に修正



(出所:ブルームバーグ)



(出所: ネットダニアー)

23:30

《EIA 米週間在庫統計》

原油在庫・・・136万バレル減少

ガソリン在庫・・・184万バレル減少

留出油在庫・・・289万バレル減少

23:40

《 NY 株式市場 序盤》

序盤の株式市場は、米国内で初めてエボラ出血熱の感染が確認されたため経済活動の停滞が懸念されるとして、航空関連をはじめ幅広い銘柄が値下がりした。また、米製造業関連の経済指標が市場予想を下回ったことも圧迫材料となった。ダウ平均株価は、序盤から軟調な動きとなり、一時前日比で180ドル安まで下落する動きとなっている。

《 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-0.2%となり、3週連続の低下となっている。借り換え申請の減少が影響した。構成指数の借り換え指数は-0.3%、購入指数は横ばいとなった。30年固定金利型の住宅ローン金利は、4.33% (前週 4.39%) と1ヵ月ぶりに低下した。また、15年固定金利型は3.55% (前週 3.56%) となった。

(2) 9月のADP民間部門の雇用者数は、前月比+21.3万人となり、市場予想の+20.5万人を上回る結果となった。業種別では、建設業は+2万人、製造業は+3.5万人、サービス業は+15.5万人となった。従業員が500人以上の大企業の雇用者数は+7.7万人、50-499人の中堅企業では+4.8万人、49人以下の小企業は8.8万人となった。

(3) 9月の米ISM製造業景況指数は、56.6となり、市場予想の58.5を下回り、前月比で3ヵ月ぶりの低下となった。生産は64.6 (前月 64.5) と前月から上昇したものの、新規受注が60.0 (66.7)、受注残が47.0 (52.5)、在庫が51.5 (52.0)、雇用が54.6 (58.1) といずれも前月から低下する結果となった。

(4) 8月の米建設支出は、年率換算で前月比-0.8%の9609億5800万ドルとなり、2ヵ月ぶりのマイナスとなった。前年同月比では+5.0%となった。民間部門と公共部門がいずれもマイナスとなり全体を押し下げた。

①民間の建設支出は、前月比-0.8%の6850億2500万ドル、前年同月比は+6.3%となった。住宅建設が前月比-0.1%の3516億9800万ドル。前年同月比では+3.7%となった。

②住宅以外の建設は前月比-1.4%。オフィスや商業、娯楽関連が減少、製造業はプラスだった。前年同月比では+9.2%となっている。

③連邦政府などの公共部門の建設支出は、前月比-0.9%の2759億3300万ドル。連邦政府が前月比-1.9%と2ヵ月連続のマイナス。2014年5月以来3ヵ月ぶりの大きな下落率となった。州・地方政府は、-0.9%となった。

(5) 全米産業審議会が発表した9月の新規のオンライン求人広告数は、255万7500件で、前月の271万7800件から減少した。前年同月の251万8800件からは+1.5%となった。2014年9月255万7500件、8月271万7800件、7月258万4000件、6月268万4900件。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6557.52	-65.20
仏 CAC40	4365.27	-50.97
独 DAX	9382.03	-92.27
ストック欧州 600 指数	340.22	-2.86
ユーロファースト 300 指数	1367.55	-12.45
スペイン IBEX35 指数	10753.20	-72.30
イタリア FTSE MIB 指数	20706.31	-185.80
南ア アフリカ全株指数	48875.03	-461.28

(出所:SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、ユーロ圏や米国の製造業関連指標の悪化したことを受けて、主要株価は軟調な動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)

1:00

米主要株価・中盤

ダウ 16871.96 (-170.94)、 S&P500 1959.71 (-12.58)、 ナスダック 4449.91 (-43.48)

《欧州のポイント》

①フランス政府は、2015年度国家予算案を公表した。経済環境を考慮して、EUが設定した財政赤字削減目標の達成を2年間先送りした。財務相は、2015年予算案の発表に臨み、財政赤字の対GDP比率を2014年の4.4%から、2015年に4.3%、2016年に3.8%と段階的に減らし、2017年には2.8%とEUが設定した3.0%をクリアする計画を明らかにした。

②9月の英製造業PMIは51.6と、前月の改定値である52.2から低下し、2013年4月以来の低水準となった。景況の改善・悪化の判断基準となる50は上回ったものの、債券高や欧州の弱い需要を反映し、新規受注指数は3ヵ月連続で低下した。

③9月のユーロ圏製造業PMIは50.3となり、節目となる50を15ヵ月連続で上回ったものの、8月の50.7から低下し、昨年7月以来の低水準となった。構成項目の新規受注指数が49.3(前月50.7)に低下し、1年超ぶりに節目を下回った。産出価格指数も48.9(50.3)に低下し、4月以来の節目割れとなった。また、ユーロ圏にもかかわらず、新規輸出受注指数も小幅低下した。

④ポーランドのコパチ首相は、ユーロ圏加盟に慎重姿勢を示し、トウスク前首相の政策路線を概ね継承する方針を示した。首相は政策演説で「強化されたユーロ圏と安定した経済。これら2つの判断基準が、単一通貨採用に最も適した時期を決定する」と強調した。首相は「ユーロ圏が歴史上最大の危機を経験したのはごく最近という事実を覚えておく必要がある」と指摘。「ポーランド、ユーロ圏諸国ともに一定の宿題を抱えている」と話した。

≪ NY 債券市場 ・ 午前 ≫

序盤のニューヨーク債券市場は、ユーロ圏の9月の製造業 PMI が低下したことに加え、9月の米 ISM 製造業景況指数や8月の建設支出が市場予想を下回ったことで、世界景気の先行きに対する懸念が広がり、安全資産とされる米国債を逃避的に買う動きが先行した。米長期金利の指標となる10年債利回りは一時、前日比べて7bP 低下の2.42%となり、9月上旬以来約1ヵ月ぶりの低水準となった。

午前の利回りは、30年債が3.15%（前日3.20%）、10年債が2.43%（2.49%）、7年債が2.14%（2.21%）、5年債が1.70%（1.76%）、3年債が0.99%（1.04%）、2年債が0.53%（0.57%）。

9月米自動車販売

- ・クライスラーは+19%（予想+16%）
- ・フォードは-2.7%（予想-2.4%）
- ・GMは+19.4%（予想は+18%）

- ・トヨタは+1.7%（予想+7.5%）
- ・日産は+18.5%（予想+17%）
- ・ホンダは+12%（予想+15%）

3:30

NY金は、中心限月が前日比3.90ドル高の1オンス=1215.50ドルで取引を終了した。

4:05

≪ 要人発言 ≫

ドラギ ECB 総裁～講演

- ・「ユーロ圏は循環的および構造的課題を抱える」

4:30

NY原油は、中心限月が前日比0.43ドル安の1バレル=90.73ドルで取引を終了した。

主要商品	終値	前日比
NY GOLD	1215.50	+3.90
NY 原油	90.73	-0.43

(出所:SBILM)

≪ NY 金市場 ≫

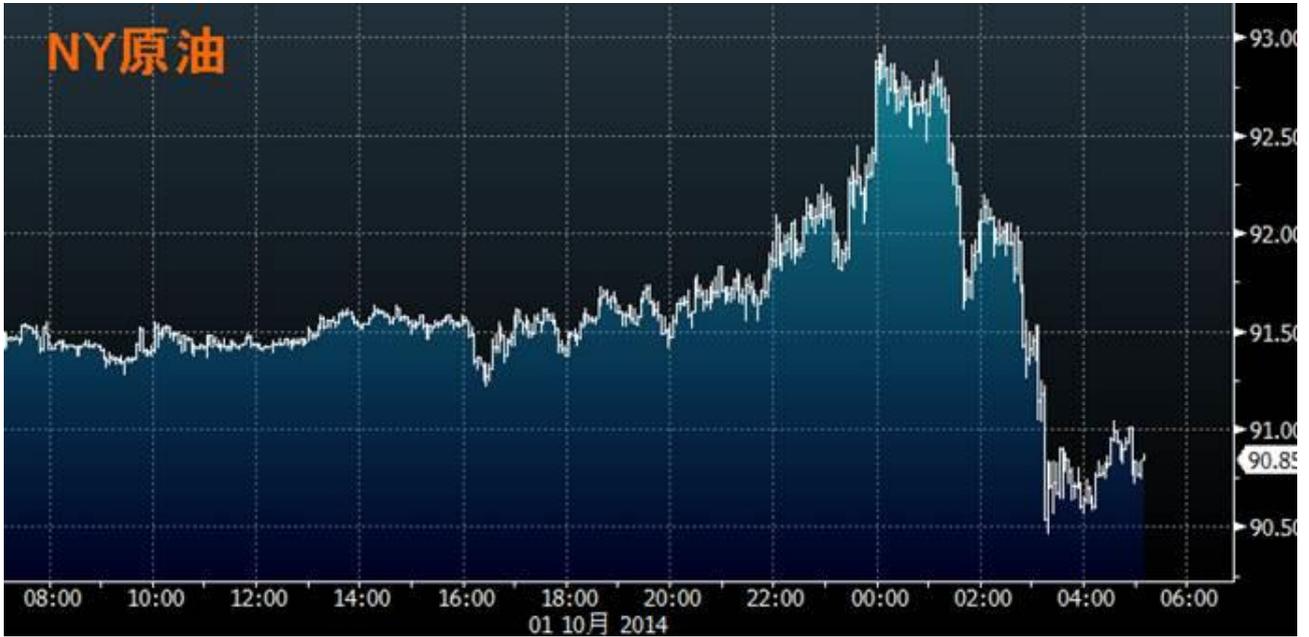
NY金は、前日に約9ヵ月ぶりの安値水準まで値下がりした反動で、序盤は買い戻しが先行した。また、ドルが円などに対して下落したことも、ドルの代替資産とされる金の買いを支えた。



(出所:ブルームバーグ)

《 NY 原油市場 》

NY原油は、中国景気の先行き不安に加え、欧米の製造業関連の景況指標が悪化したことで世界経済減速によるエネルギー需要の鈍化懸念が一段と強まり、売りが優勢となった。ただ、米石油在庫統計で原油在庫が市場の予想に反して減少したことを好感し、買いが入る場面もあった。終値ベースでは、2013年4月下旬以来、約1年5ヵ月ぶりの安値水準となった。



(出所:ブルームバーグ)

主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	16804.71	-238.19	17041.16	16776.13
S&P500種	1946.16	-26.13	1971.44	1941.72
ナスダック	4422.09	-71.30	4486.79	4409.30

(出所:SBILM)

《 米株式市場 》

米株式市場は、米国内で初めてエボラ出血熱の感染が確認されたため経済活動の停滞が懸念されるとして、航空関連をはじめ幅広い銘柄が値下がりした。また、製造業や建設関連の米経済指標が市場予想を下回ったことも圧迫材料となり、主要株価は大幅安となった。ダウ平均株価は、序盤から軟調な動きとなり、一時前日比で266ドル安まで下落する場面もあった。



(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	109.01	109.99	108.90
EUR/JPY	137.53	138.55	137.40
GBP/JPY	176.37	178.05	176.19
AUD/JPY	95.20	95.67	95.10
NZD/JPY	84.83	85.91	84.71
EUR/USD	1.2618	1.2640	1.2583
AUD/USD	0.8734	0.8748	0.8689

(出所:SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、米製造業や建設関連の経済指標が予想を下回る結果となったことや、欧米の株価が大きく下落したことなどから、投資家のリスク回避の動きが強まり、ドル円・クロス円は軟調な展開が続いた。また、米長期債利回りが低下したことも、円買いに拍車をかけ、円は大半の主要通貨に対して上昇する動きとなった。



(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、複写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。