

NY マーケットレポート (2014年10月3日)

NY市場では、米雇用統計で景気動向を敏感に映す非農業部門の雇用者数が市場予想を上回り、減速した前月から持ち直す結果となったことや、失業率が2008年7月以来の5%台へ改善したことを受けて、ドルが主要通貨に対して上昇する動きとなった。また、米長期債利回りが上昇したことも加わり、ドル/円は109.91まで上昇する動きとなった。そして、欧米の株価が大きく上昇したことから、クロス円も堅調な動きとなった。ただ、クロス円の上値は限定的となった。

2014/10/3 (金)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	108.86	108.96	108.36
EUR/JPY	137.63	137.88	137.29
GBP/JPY	175.14	175.92	174.98
AUD/JPY	95.57	95.88	95.30
EUR/USD	1.2645	1.2676	1.2641

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	109.03	108.76
EUR/JPY	137.64	137.41
GBP/JPY	175.28	175.01
AUD/JPY	95.65	95.37
EUR/USD	1.2646	1.2611

*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	15708.65	+46.66
ハンセン指数	23064.56	+131.58
上海総合	休場	
韓国総合指数	休場	
豪ASX200	5318.21	+20.51
インドSENSEX指数	休場	
シンガポールST指数	3253.24	+24.53

×中国市場は国慶節、インド市場はMahatma Gandhis Birthdayのため休場

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6527.91	+81.52
仏CAC40	4281.74	+39.07
独DAX	休場	
ST欧州600	335.19	+3.14
西IBEX35指数	10567.60	+149.50
伊FTSE MIB指数	20200.62	+305.74
南ア 全株指数	48613.19	+424.13

×独市場はGerman Unity Day(ドイツ統一記念日)のため休場

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	109.80	109.91	108.87
EUR/JPY	137.37	137.59	137.11
GBP/JPY	175.36	175.67	175.04
AUD/JPY	95.18	95.52	94.95
NZD/JPY	85.26	85.73	84.97
EUR/USD	1.2513	1.2619	1.2500
AUD/USD	0.8669	0.8765	0.8643

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17009.69	+208.64
S&P500	1967.90	+21.73
NASDAQ	4475.63	+45.43
その他主要株	終値	前日比
🇨🇦 トロント総合	14789.78	+29.14
🇧🇷 ボルサ指数	44678.14	+423.71
🇨🇵 ポベスパ指数	54539.55	+1020.98

10/6 経済指標スケジュール

08:00 【NZ】9月QV住宅価格
 09:30 【豪】9月ANZ求人広告件数
 15:00 【独】8月製造業受注
 17:30 【欧】10月センチックス投資家信頼感
 22:00 【メキシコ】8月景気先行指数
 23:00 【カナダ】9月Ivey購買部協会指数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1192.90	-22.20
NY 原油	89.74	-1.27
CMEコーン	323.25	+0.50
CBOT 大豆	912.25	-12.25

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.56%	0.53%
3年債	1.03%	0.99%
5年債	1.72%	1.70%
7年債	2.15%	2.14%
10年債	2.44%	2.44%
30年債	3.13%	3.15%

10/6 主要会議・講演・その他予定

(出所:SBILM)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 108.99 ユーロ/円 137.46 ユーロ/ドル 1.2614

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	6504.00	+57.61	ダウ INDEX FUTURE	16805	+81
仏 CAC40	4265.95	+23.28	S&P500 FUTURE	1949.30	+10.70
独 DAX	休 場		NASDAQ FUTURE	3998.00	+20.00

* 独市場は German Unity Day (ドイツ統一記念日) のため休場

(出所: SBILM)

21:30

◀ 経済指標の結果 ▶

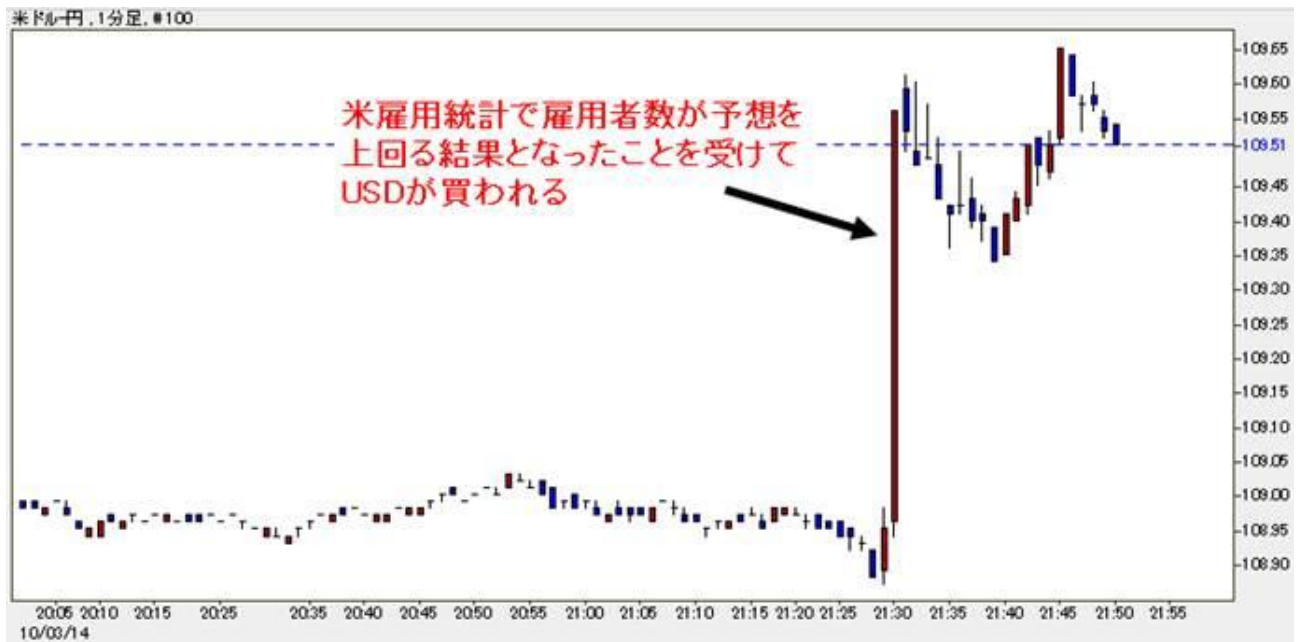
9月米失業率 5.9% (予想 6.1%・前回 6.1%)
 9月米非農業部門雇用者数 24.8万人 (予想 21.5万人・前回 18.0万人)
 前回発表の 14.2万人から 18.0万人に修正
 9月米民間部門雇用者数 23.6万人 (予想 21.0万人・前回 17.5万人)
 前回発表の 13.4万人から 17.5万人に修正
 9月米製造業雇用者数 0.4万人 (予想 1.3万人・前回 -0.4万人)
 前回発表の 0.0万人から -0.4万人に修正
 9月米平均時給 (前月比) 0.0% (予想 0.2%・前回 0.3%)
 前回発表の 0.2%から 0.3%に修正
 9月米平均時給 (前年比) 2.0% (予想 2.2%・前回 2.1%)
 9月米週平均労働時間 34.6 (予想 34.5・前回 34.5)
 9月米労働参加率 62.7% (前回 62.8%)



(出所:ブルームバーグ)



(出所:ブルームバーグ)



(出所:ネットダニアー)

21 : 30

< 経済指標の結果 >

8月米貿易収支 -401億USD (予想 -408億USD・前回 -403億USD)

前回発表の-405億USDから-403億USDに修正



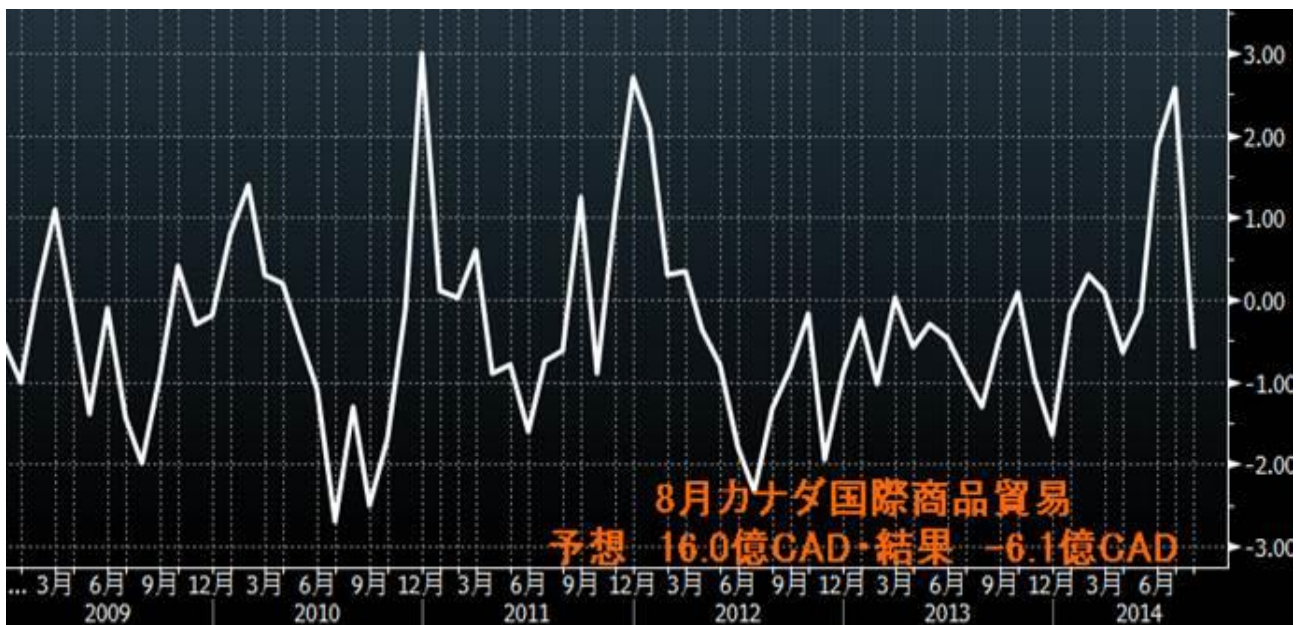
(出所:ブルームバーグ)

21 : 30

< 経済指標の結果 >

8月カナダ国際商品貿易 -6.1億CAD (予想 16.0億CAD・前回 22.0億CAD)

前回発表の25.8億CADから22.0億CAD



(出所:ブルームバーグ)

22:00

スペイン、カタルーニャが11月9日の住民投票実施を宣言。

◀ NY 外国為替市場 序盤 ▶

序盤の外国為替市場は、9月の米雇用統計で、非農業部門雇用者数の伸びが予想を上回ったことや、失業率が2008年7月以来の低水準となったことを受けて、ドルは主要通貨に対して上昇する動きとなった。

22:33

米主要株価

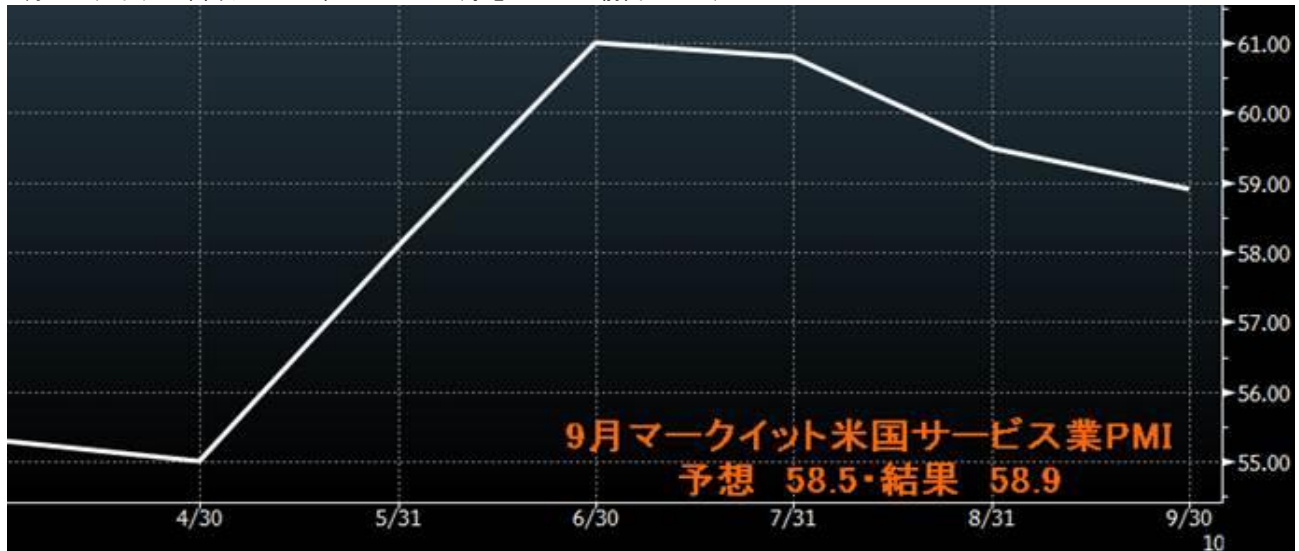
米主要株	株価	前日比
ダウ平均	16900.54	+99.49
ナスダック	4456.83	+26.63

(出所:SBILM)

22:45

◀ 経済指標の結果 ▶

9月マークイット米国サービス業PMI 58.9 (予想 58.5・前回 58.5)



(出所:ブルームバーグ)

23:00

◀ 経済指標の結果 ▶

9月ISM非製造業景況指数 58.6 (予想 58.5・前回 59.6)



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

◀ ISM 非製造業景況指数 ▶

	9月	8月	7月	6月	5月	4月	3月
総合指数	58.6	59.6	58.7	56.0	56.3	55.2	53.1
景況指数	62.9	65.0	62.4	57.5	62.1	60.9	53.4
仕入価格	55.2	57.7	60.9	61.2	61.4	60.8	58.3
新規受注	61.0	63.8	64.9	61.2	60.5	58.2	53.4
雇用者数	58.5	57.1	56.0	54.4	52.4	51.3	53.6

23:30

◀ NY 株式市場 序盤 ▶

序盤の株式市場は、9月の米雇用統計で失業率や雇用者数の伸びが大きく改善したため、米景気に楽観的な見方が広がり、主要株価はほぼ全面高となった。ダウ平均株価は、前日まで4日連続で値下がりしたこと、値頃感が強まったことによる買い戻しも入った。

◀ 経済指標のポイント ▶

(1) 9月の米雇用統計は、非農業部門の雇用者数が+24.8万人と市場予想の+21.5万人を大きく上回り、減速した前月から持ち直した。また、失業率も5.9%と2008年7月以来の5%台へ改善した。

①非農業部門の雇用者数は、8月分は+14.2万人から+18.0万人に、7月分も+21.2万人から+24.3万人上方修正された。

②民間部門が+23.6万人、小売業が大きく伸びたほか、製造業も小幅なプラスを維持した。また、企業向け専門サービスや金融もプラスとなった。政府部門は+1.2万人、連邦、地方が減少する一方、州が大きく伸びた。

③失業期間別にみると、半年以上の長期失業者数は-0.9万人の295.4万人と失業者全体の31.9%を占めた。

(2) 8月の米貿易収支では、赤字額がモノとサービスを合わせた国際収支ベースで前月比-0.5%の401億900万ドル(約4兆4000億円)と4ヵ月連続で縮小した。

①ハイテク製品の輸出が伸び、対日赤字が急減。また、中南米や新興国への輸出が大きく増えた結果、輸出総額は+0.2%の1984億5900万ドルと過去最高を更新した。一方、原油価格の下落で産油国からの輸入が減り、輸入総額は+0.1%の2385億6800万ドルとなった。

②モノの貿易赤字は、-17.6%の583億1500万ドル。輸出が1996年3月以来の高水準となった。そして、対日赤字は-23.8%と大きく縮小、対中赤字も-2.2%となった。

(3) 9月のISM非製造業総合景況指数は、58.6と前月の59.6から低下したものの、第3四半期の平均値は2004年1-3月以来の高い水準となった。当該指数は50が活動の拡大と縮小の判断基準となる。

①項目別では、雇用指数は58.5(前月57.1)と、2005年8月以来の高水準となった。しかし、新規受注は61.0(前月63.8)、仕入れ価格指数は55.2(前月57.7)と2月以来の低水準となり、景況指数は62.9(前月65)となった。

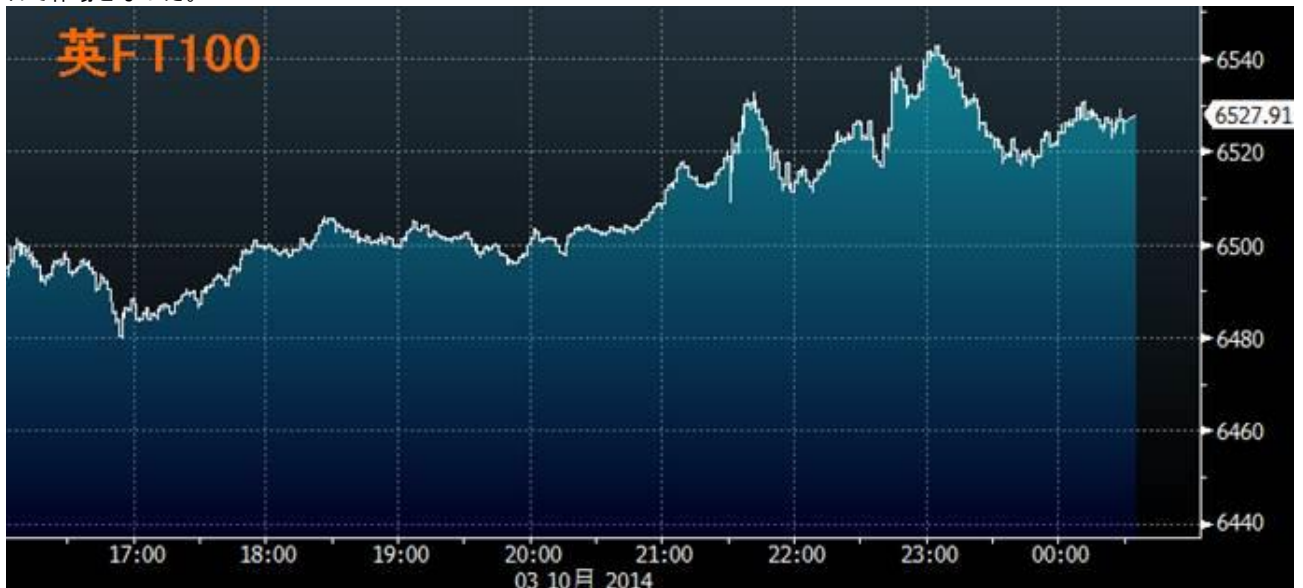
欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6527.91	+81.52
仏 CAC40	4281.74	+39.07
独 DAX	休場	
ストック欧州 600 指数	335.19	+3.14
ユーロファースト 300 指数	1347.14	+12.37
スペイン IBEX35 指数	10567.60	+149.50
イタリア FTSE MIB 指数	20200.62	+305.74
南ア アフリカ全株指数	48613.19	+424.13

* 独市場は German Unity Day (ドイツ統一記念日) のため休場

(出所: SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、前日大幅に下げた反動で、割安感が出た銘柄を中心に買いが先行した。午後にかけては、米雇用統計で失業率や雇用者数が大きく改善したことを受けて米景気の先行き期待が広がり、主要株価は一段高となった。独市場はドイツ統一記念日で休場となった。



(出所:ブルームバーグ)

1:00

米主要株価・中盤

ダウ 16941.33 (+140.28)、 S&P500 1962.84 (+16.67)、 ナスダック 4476.23 (+46.04)

《NY債券市場・午前》

序盤のニューヨーク債券市場は、9月の米雇用統計で非農業部門雇用者数の伸びが市場予想を上回り、失業率も6年2ヵ月ぶりの水準に改善したことで米景気が堅調に回復しているとの見方が広がり、安全資産とされる米国債の売りが先行した。また、米国の早期利上げへの警戒感も強まって、政策金利の動向に敏感な短期債が特に大きく売られ、利回り曲線はベアフラット化した。

午前の利回りは、30年債が3.16%（前日3.15%）、10年債が2.47%（2.44%）、7年債が2.19%（2.14%）、5年債が1.76%（1.70%）、3年債が1.05%（0.99%）、2年債が0.57%（0.53%）。

《欧州のポイント》

①9月のユーロ圏PMIは、製造業とサービス部門をあわせた総合が52.0と、前月の52.5から低下し、今年最低を記録。速報値の52.3から下方修正され、新規受注はほぼ1年ぶり低水準を記録した。ただ、景況の改善を意味する50は15ヵ月連続で上回っている。サービス部門PMI改定値は52.4で、前月の53.1から低下。速報値で52.8から下方修正された。総合産出価格指数は、1年2ヵ月ぶり低水準となる48.5を記録。2012年4月以来、50を下回っている。新規受注指数は、約1年ぶり低水準となった。

②EU統計局が発表した8月のユーロ圏小売売上高は、前月比+1.2%、前年比+1.9%となり、いずれも市場予想を上回る結果となった。前月比ベースでは、食品除く商品と燃料の売上高の伸びが特に目立った。前年比ベースでは、食品と燃料の売上高が-0.2%だったが、食品以外は+3.6%となった。ドイツの小売り売上高は+3.1%、フランスは+2.1%となった。

③イタリア財務省、銀行協会、中銀、預託貸付公庫の各代表が、比較的リスクの高い資産担保証券に政府保証をつけることを検討している。ECBが新たに開始する資産担保証券買い入れの対象にするのが狙い。ABSのなかで、シニアと呼ばれる信用力の高い部分と、低い部分の中間に位置する「メザニン」債に政府保証をつけるかどうか協議した。

④スペインのカタルーニャ自治州のマス首相は、カタルーニャ州の独立を問う住民投票を計画通り11月9日に実施すると宣言した。州政府は、投票実施の宣言を撤回しないと報道官が言明した。発言はテレビで放映された。マス首相は、投票実施を支持する3党の党首と会談した。一方、スペインの憲法裁判所は投票差し止めの命令を出している。

3:30

NY金は、中心限月が前日比22.20ドル安の1オンス=1192.90ドルで取引を終了した。

4:15

NY原油は、中心限月が前日比1.27ドル安の1バレル=89.74ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1192.90	-22.20
NY 原油	89.74	-1.27

(出所:SBILM)

《 NY 金市場 》

NY 金は、9 月の米雇用統計が大幅に改善したことで米国の利上げが近づいていることが意識され売りが優勢となった。また、ドルが主要通貨に対して上昇し、ドル建てに割高感が出たことも圧迫材料となった。終値ベースでは 2010 年 8 月以来、約 4 年 2 カ月ぶりの安値水準となった。



(出所:ブルームバーグ)

《 NY 原油市場 》

NY 原油は、世界的な供給過剰感が引き続き材料視され、売りが優勢となった。そして、ドルが主要通貨に対して上昇したことも圧迫要因となった。ただ、米雇用統計の大幅改善を受けて米景気の先行き期待が広がったことから、下げ幅が縮小する動きも見られた。終値ベースでは、90 ドルを割り込んだのは 2013 年 4 月下旬以来、約 1 年 5 カ月ぶり。



(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	17009.69	+208.64	17027.84	16802.20
S&P500 種	1967.90	+21.73	1971.19	1948.12
ナスダック	4475.63	45.43	4488.07	4445.72

(出所: SBILM)

〈米株式市場〉

米株式市場は、9月の米雇用統計で失業率や雇用者数の伸びが大きく改善したため、米景気に楽観的な見方が広がり、主要株価はほぼ全面高となった。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226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	109.80	109.91	108.87
EUR/JPY	137.37	137.59	137.11
GBP/JPY	175.36	175.67	175.04
AUD/JPY	95.18	95.52	94.95
NZD/JPY	85.26	85.73	84.97
EUR/USD	1.2513	1.2619	1.2500
AUD/USD	0.8669	0.8765	0.8643

(出所: SBILM.)

《外国為替市場》

外国為替市場は、米国の雇用統計が市場予想より良好な内容となったことを受けて、ドルが主要通貨に対して上昇する動きとなった。また、欧米の株価が大きく上昇したことから、クロス円も上昇となったものの、クロス円の上値はやや限定的となった。



(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。