

NY マーケットレポート (2014 年 10 月 17 日)

NY 市場では、序盤に発表された米住宅着工件数が市場予想を上回ったことや、ミシガン大学消費者信頼感指数が 2007 年 7 月以来 7 年 3 ヶ月ぶりの高水準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、ここまで下落が続いた欧米の主要株価が大きく上昇したことから、逃避先として買われていた円を売る動きが強まったことから、ドル円・クロス円は終盤まで堅調な展開が続いた。円は主要 31 通貨の大半に対して下落する動きとなった。また、世界の主要中銀が金融緩和策を維持、あるいは強化するとの観測を背景に、新興国通貨は上昇する動きとなった。

2014/10/17 (金)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	106.44	106.50	106.14
EUR/JPY	136.07	136.41	135.75
GBP/JPY	170.95	171.49	170.21
AUD/JPY	93.38	93.51	92.75
EUR/USD	1.2786	1.2860	1.2782

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	106.63	106.37
EUR/JPY	136.72	136.07
GBP/JPY	171.89	170.91
AUD/JPY	93.72	93.34
EUR/USD	1.2837	1.2782

*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	14532.51	-205.87
ハンセン指数	23023.21	+122.27
上海総合	2341.18	-15.32
韓国総合指数	1900.66	-18.17
豪ASX200	5271.72	+16.83
インドSENSEX指数	26108.53	+109.19
シンガポールST指数	3167.73	+13.52

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6310.29	+114.38
仏CAC40	4033.18	+114.56
独DAX	8850.27	+267.37
ST欧州600	318.68	+8.65
西IBEX35指数	9956.80	+287.10
伊FTSE MIB指数	18700.98	+617.87
南ア 全株指数	47836.69	955.57

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	106.89	106.95	106.36
EUR/JPY	136.38	136.55	136.04
GBP/JPY	171.97	172.06	171.25
AUD/JPY	93.64	93.73	93.28
NZD/JPY	84.68	84.87	84.41
EUR/USD	1.2761	1.2837	1.2745
AUD/USD	0.8761	0.8812	0.8744

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	16380.41	+263.17
S&P500	1886.76	+24.00
NASDAQ	4258.44	+41.05
その他主要株	終値	前日比
カナダトロント総合	14227.68	+174.71
ロシアボルサ指数	43273.50	+365.88
ブラジルボベスパ指数	55723.79	+1425.46

10/20 経済指標スケジュール

08:01 【英】10月ライトムーブ住宅価格
 14:00 【日】8月景気一致CI指数
 14:00 【日】8月景気先行CI指数
 14:30 【日】9月全国百貨店売上高
 15:00 【独】9月生産者物価指数
 16:00 【日】9月コンビニエンスストア売上高
 17:00 【欧】8月経常収支
 17:30 【香港】9月失業率
 21:30 【カナダ】8月卸売売上高

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1239.00	-2.20
NY 原油	82.75	+0.05
CMEコーン	348.00	-4.25
CBOT 大豆	951.75	-14.75

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.37%	0.34%
3年債	0.79%	0.75%
5年債	1.42%	1.37%
7年債	1.86%	1.82%
10年債	2.20%	2.16%
30年債	2.97%	2.94%

10/20 主要会議・講演・その他予定

- ・黒田日銀総裁 挨拶
- ・欧州議会本会議

(出所: SBILM)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 106.39 ユーロ/円 136.53 ユーロ/ドル 1.2834

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	6248.92	+53.01	ダウ INDEX FUTURE	16194	+179
仏 CAC40	3991.84	+73.22	S&P500 FUTURE	1876.10	+25.50
独 DAX	8729.70	+146.80	NASDAQ FUTURE	3797.00	+55.50

(出所: SBILM)

21:00

◀ 経済指標の結果 ▶

9月ポーランド鉱工業生産販売(前月比) 16.5% (予想 14.5%・前回 -8.5%)

9月ポーランド鉱工業生産販売(前月比) 4.2% (予想 2.7%・前回 -1.9%)

9月ポーランド生産者物価指数(前月比) 0.1% (予想 0.1%・前回 0.3%)

9月ポーランド生産者物価指数(前年比) -1.6% (予想 -1.5%・前回 -1.5%)



(出所: ブルームバーグ)



(出所:ブルームバーグ)

21:00

《 要人発言 》

ローゼングレン・ボストン連銀総裁

- ・「最近の市場のボラティリティでFRBが政策変更するか判断するのは時期尚早」
- ・「債券買い入れに関する変更、米経済見通し変わった時のみ検討」
- ・「2015年半ばの利上げ開始なお可能性高い」
- ・「ドル高・原油安がインフレ見通し抑制の見込み」
- ・「米インフレ率は、2%の目標回帰に数年要する可能性高い」
- ・「QE再開は想定せず、経済弱含めば可能性排除せず」

21:30

《 経済指標の結果 》

9月米住宅着工件数 101.7万件 (予想 100.8万件・前回 95.7万件)
前回発表の95.6万件から95.7万件に修正

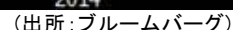
9月米住宅着工件数(前月比) 6.3% (予想 5.4%・前回 -12.8%)
前回発表の-14.4%から-12.8%に修正

9月米建設許可件数 101.8万件 (予想 103.0万件・前回 100.3万件)
前回発表の99.8万件から100.3万件に修正

9月米建設許可件数(前月比) 1.5% (予想 -5.6%・前回 -5.1%)
前回発表の-5.6%から-5.1%に修正



(出所:ブルームバーグ)



《米住宅着工・許可件数》

9月・・・8月・・・7月・・6月・・5月・・4月・・3月

住宅着工件数 . . . 101.7 . . 95.7 . . 109.8 . . 90.9 . . 98.4 . . 106.3 . . 95.0

一戸建て住宅・・・64.6・・・63.9・・・65.2・・・59.3・・・63.4・・・64.9・・・63.5

集合住宅 37.1 . . 31.8 . . 44.6 . . 31.6 . . 35.0 . . 41.4 . . 31.5

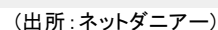
許可件数 101.8 . . 1003 . . 105.7 . . 97.3 . . 100.5 . . 105.9 . . 100.0

一戸建て住宅・・・62.4・・・62.7・・・63.1・・・63.4・・・61.5・・・59.7・・・60.0

集合住宅 39.4 . . 37.6 . . 42.6 . . 33.9 . . 39.0 . . 46.2 . . 40.0

住宅着工 6.3 . . -12.8 . . 20.8 . . -7.6 . . -7.4 . . 11.9 . . 2.4

住宅建設許可 . . . 1.5 . . -5.1 . . 8.6 . . -3.2 . . -5.1 . . 5.9 . . -1.1



21 : 30

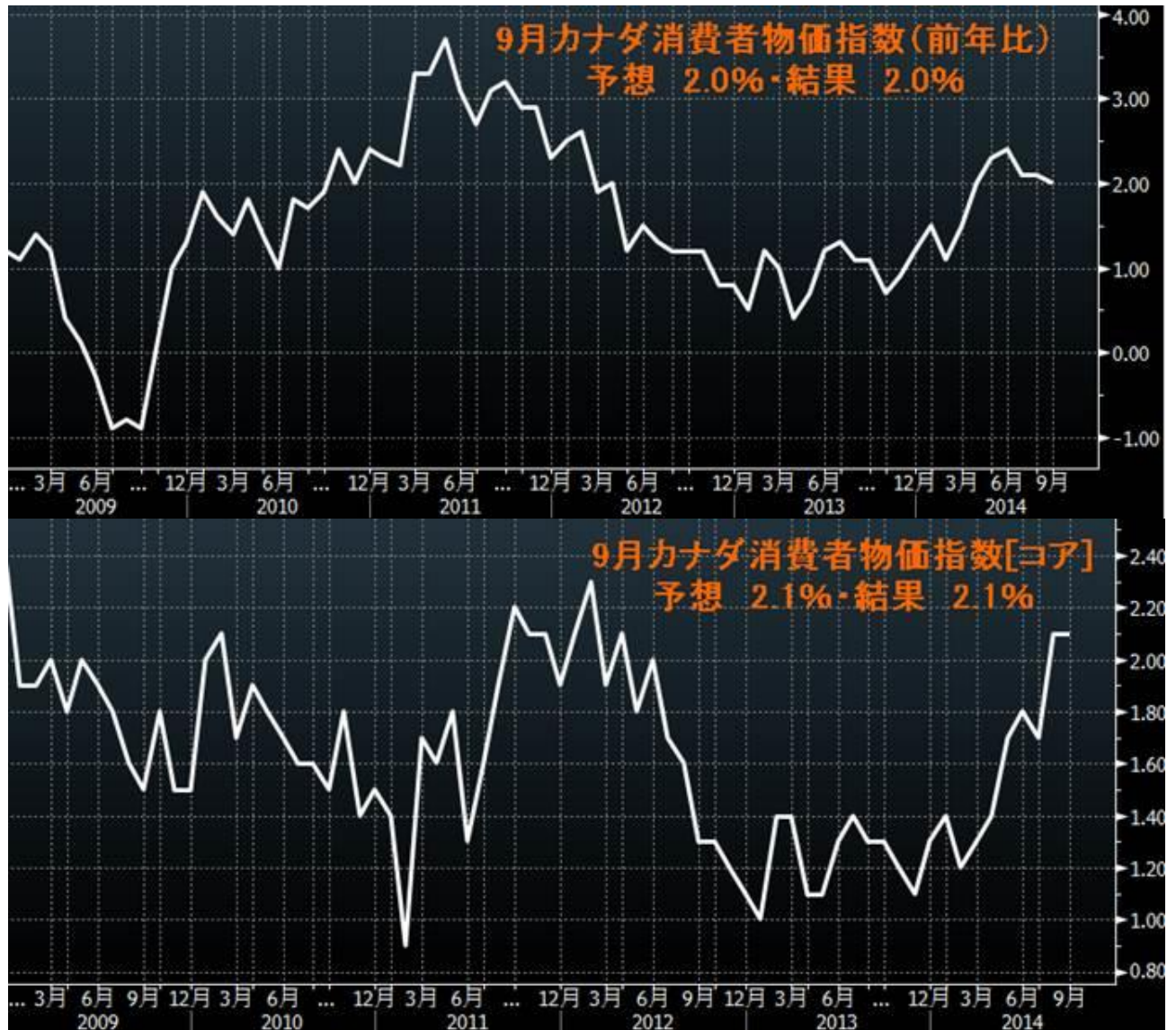
◀ 経済指標の結果 ▶

9月カナダ消費者物価指数（前月比） 0.1%（予想 0.1%・前回 0.0%）

9月カナダ消費者物価指数[コア] 0.2%（予想 0.2%・前回 0.5%）

9月カナダ消費者物価指数（前年比） 2.0%（予想 2.0%・前回 2.1%）

9月カナダ消費者物価指数[コア] 2.1%（予想 2.1%・前回 2.1%）



(出所:ブルームバーグ)

22 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

9 月メキシコ失業率(季調前) 5.08% (予想 5.20%・前回 5.18%)

9 月メキシコ失業率(季調済) 4.75% (予想 4.80%・前回 4.87%)



(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	16265.90	-148.66
ナスダック	4271.98	+54.59

(出所:SBILM)

22 : 55

◀ 経済指標の結果 ▶

10 月ミシガン大学消費者信頼感指数 86.4 (予想 84.0・前回 84.6)



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

《ミシガン大学消費者信頼感指数》

	10月	9月	8月	7月	6月	5月	4月
消費者信頼感	86.4	84.6	82.5	81.8	82.5	81.9	84.1
景気現況指数	98.9	98.9	99.8	97.4	96.6	94.5	98.7
消費者期待指数	78.4	75.4	71.3	71.8	73.5	73.7	74.7
1年インフレ	2.8	3.0	3.2	3.3	3.1	3.3	3.2
5年インフレ	2.8	2.8	2.9	2.7	2.9	2.8	2.9

23:30

《NY株式市場 序盤》

序盤の株式市場は、最近の主要株価の下落を受けて、割安となった銘柄を買い戻す動きが優勢となり、主要株価は堅調な動きとなっている。また、欧州の主要株価が上昇したことも、買い安心感につながった。

《経済指標のポイント》

(1) 9月の米住宅着工件数は、年率換算で前月比+6.3%の101.7万件と、市場予想の100.4万件を上回った。前年同月比は+17.8%となった。着工件数の先行指標となる建設許可件数は、前月比+1.5%の101.8万件と市場予想の102.9万件を下回った。前年同月比は+2.5%となった。着工件数の地域別は、最大市場の南部が+4.2%、北東部が+5.3%、中西部が+3.5%、西部が+13.9%となった。

(2) 10月のミシガン大学消費者信頼感指数の速報値は、86.4と市場予想の84.0を上回り、9月の確報値から1.8ポイント上昇し、2007年7月以来、7年3ヵ月ぶりの高水準となった。現状指数は98.9と9月確報値から横ばい。1年後のインフレ期待は2.8%で9月確報値から0.2ポイント低下した。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6310.29	+114.38
仏 CAC40	4033.18	+114.56
独 DAX	8850.27	+267.37
ストック欧州 600 指数	318.68	+8.65
ユーロファースト 300 指数	1280.17	+34.39
スペイン IBEX35 指数	9956.80	+287.10
イタリア FTSE MIB 指数	18700.98	+617.87
南ア アフリカ全株指数	47836.69	+955.57

(出所:SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、最近の大幅下落で値頃感が出た銘柄を中心に買いが先行した。また、米経済指標の改善を好感して一段高となり、主要株価は大幅高となった。独 DAX は 3.12%高、英 FT100 は 1.85%高、仏 CAC40 は 2.92%高といずれも大幅高となった。



(出所:ブルームバーグ)

1:00

米主要株価・中盤

ダウ 16410.59 (+293.35)、 S&P500 1897.18 (+34.42)、 ナスダック 4287.97 (+70.58)

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、欧米株の上昇を受けて投資家のリスク志向が回復し、安全資産とされる米国債を売る動きが先行した。また、9月の米住宅着工件数や10月のミシガン大消費者信頼感指数が市場予想を上回ったことから、米景気の先行き不安が後退したことも国債の売り材料となった。

午前の利回りは、30年債が2.99%（前日2.93%）、10年債が2.21%（2.15%）、7年債が1.88%（1.81%）、5年債が1.42%（1.37%）、3年債が0.79%（0.75%）、2年債が0.37%（0.34%）。

《 欧州のポイント 》

①キプロスの財務相は、2014年はマイナス成長になるものの、観光収入の好調とサービス産業の回復でマイナス幅は3%を切るとの見通しを示した。8月は、訪問観光客数が前年同月比で+5.9%、不動産取引や会社設立の登記も増えているという。2015年予算発表の際に「このまま現在の傾向が続けば、景気後退のサイクルが終了したとみることができる」と述べた。キプロスは2011年以来マイナス成長が続いており、昨年は-5.4%に達していた。

②EU統計局は、ユーロ圏の第1、第2・四半期のGDP改定値は、それぞれ季節調整済みで前期比+0.2%から+0.3%、変わらずから+0.1%に上方修正した。EU統計規則の改正に伴い、9月から導入された新たな算出方法に基づく改定としている。新ルールでは、研究開発や兵器システムなどを投資と見なす。EU全体のGDPは第1・四半期が+0.3%から+0.4%に上方修正、第2・四半期は+0.2%で変わらずとなった。第2・四半期のユーロ圏GDPは、前年比では+0.7%から+0.8%に改定された。

《 欧州債券市場 》

欧州債市場は、ECBが緩和策の一部であるカバード債の購入を可能にする法案が18日に施行されると発表したことを手掛かりに、イタリアとスペインの国債が3日ぶりに上昇し、ギリシャ国債も上昇した。一方、ドイツ10年債は続落し、今週の上げ幅を削った。

イタリア10年債利回りは前日比8bp低下の2.50%、スペイン10年債利回りは4bp低下の2.17%、またギリシャ10年債利回りは90bp低下の8.07%。ドイツ10年債利回りは、前日比4bp上昇の0.86%となった。

3:30

NY金は、中心限月が前日比2.20ドル安の1オンス=1239.00ドルで取引を終了した。

4:30

NY原油は、中心限月が前日比0.05ドル高の1バレル=82.75ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1239.00	-2.20
NY 原油	82.75	+0.05

(出所:SBILM)

《 NY 金市場 》

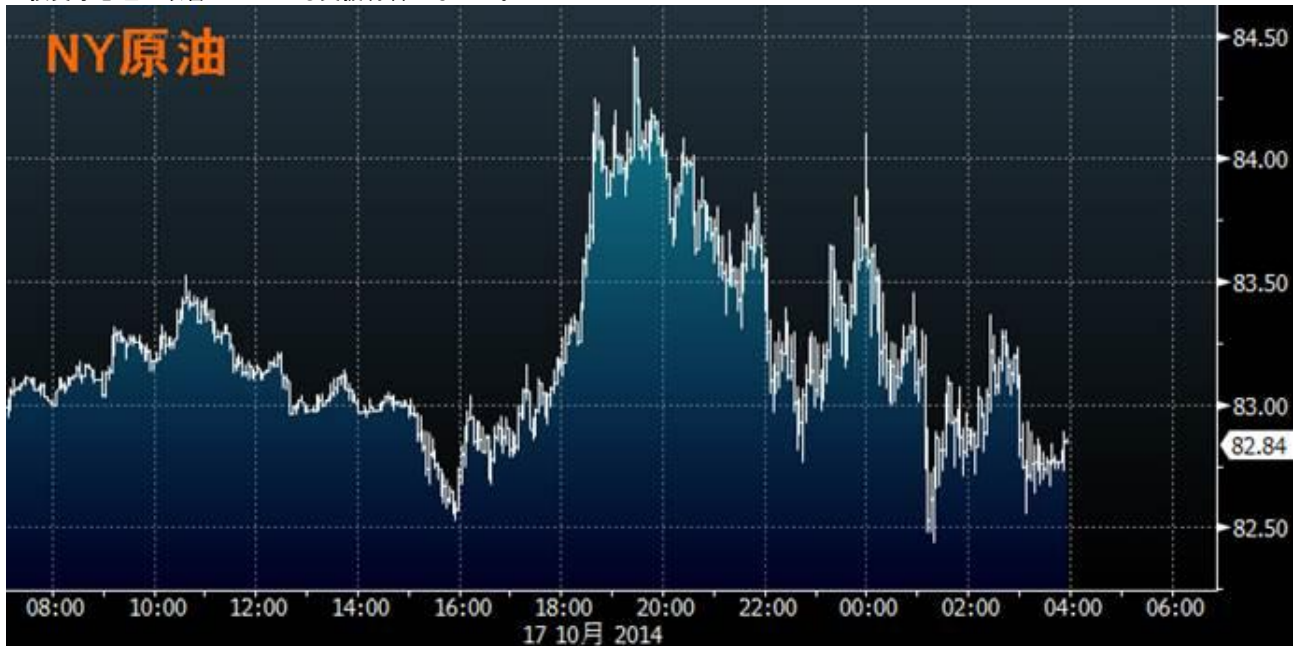
NY金は、米国株の大幅上昇を受けてリスク回避の姿勢が弱まり、比較的安全な資産とされる金を売る動きが優勢となった。また、9月の住宅着工件数などの米経済指標が市場予想を上回ったことも圧迫要因となった。



(出所:ブルームバーグ)

<< NY 原油市場 >>

NY 原油は、最近の相場急落の反動で、値頃感の買い戻しが優勢となった。また、欧州や米国で株価が大幅上昇したことを受けて投資家心理が改善したことも支援材料となった。



(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	16380.41	+263.17	16427.38	16118.39
S&P500 種	1886.76	+24.00	1898.16	1864.91
ナスダック	4258.44	+41.05	4296.11	4241.67

(出所:SBILM)

<< 米株式市場 >>

米株式市場は、最近の主要株価の下落を受けて、割安となった銘柄を買い戻す動きが優勢となり、主要株価は序盤から堅調な動きとなった。また、米住宅関連や消費者関連の経済指標が予想を上回る結果となったことも好感され、大幅な上昇となった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、前日比で310ドル高まで上昇する動きとなった。



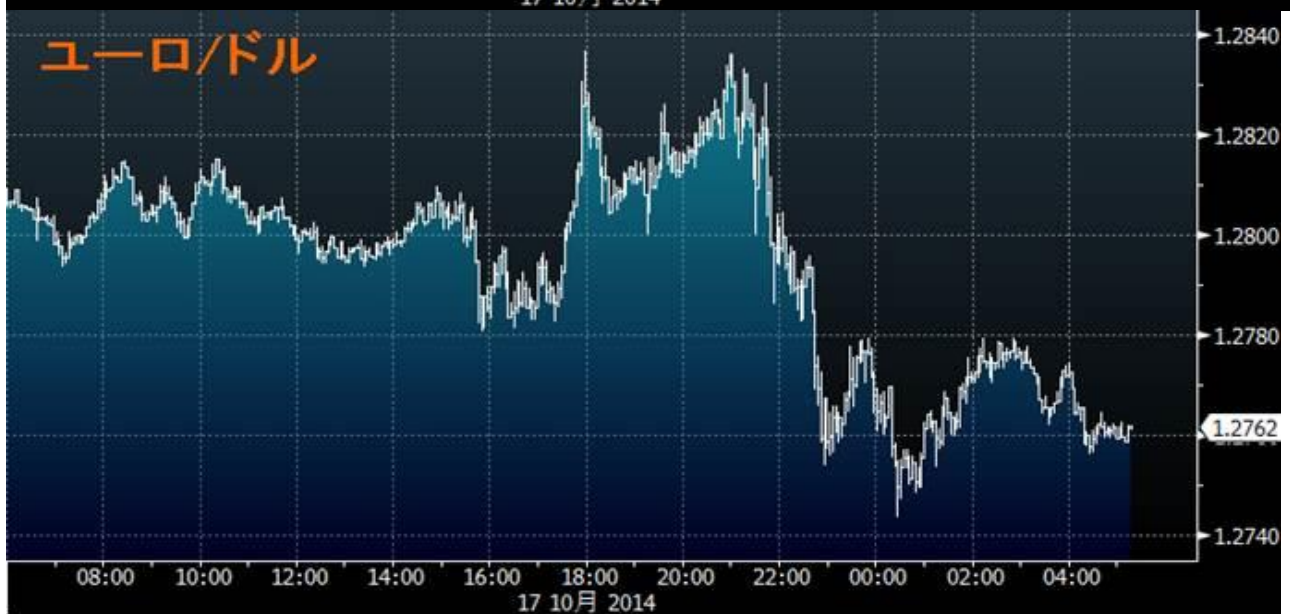
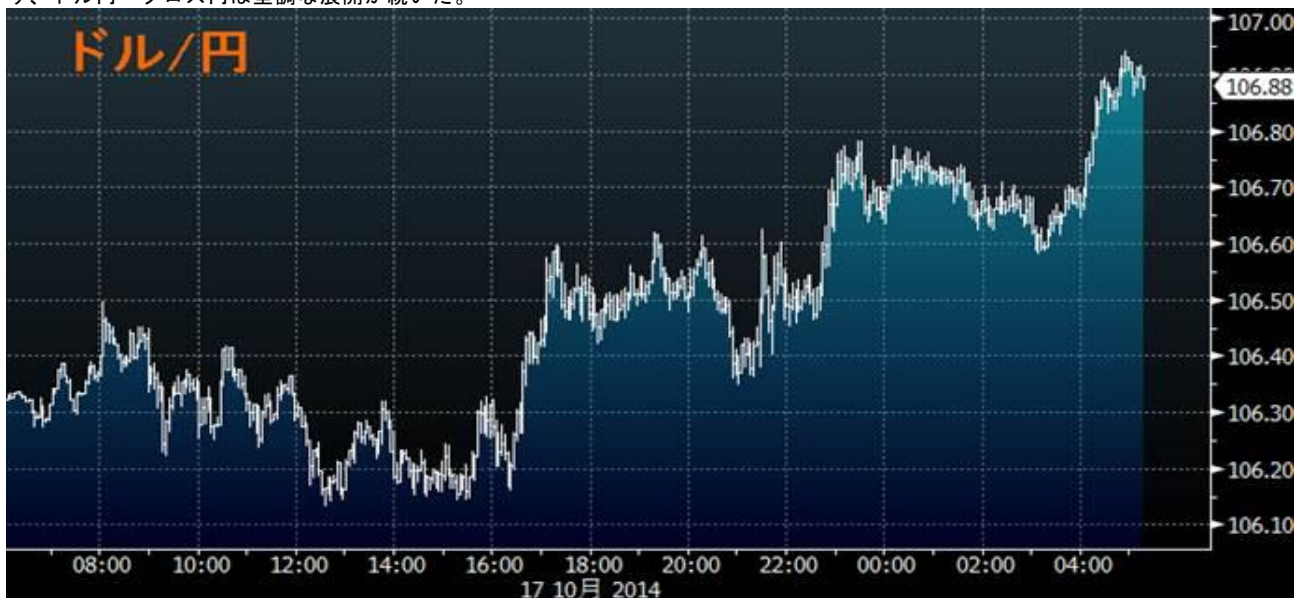
(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	106.89	106.95	106.36
EUR/JPY	136.38	136.55	136.04
GBP/JPY	171.97	172.06	171.25
AUD/JPY	93.64	93.73	93.28
NZD/JPY	84.68	84.87	84.41
EUR/USD	1.2761	1.2837	1.2745
AUD/USD	0.8761	0.8812	0.8744

(出所:SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、米経済指標が予想以上に良好な結果となったことや、欧米の株価が大きく上昇したことを受けて、投資家のリスク回避の動きが後退し、安全資産として買われた円を売る動きが優勢となった。円は大半の主要通貨に対して軟調な動きとなり、ドル円・クロス円は堅調な展開が続いた。



(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。