

NY マーケットレポート (2014 年 10 月 23 日)

NY 市場では、欧州市場の流れを受けて、ドル円・クロス円は堅調な展開で始まった。序盤に発表された米製造業関連の経済指標が予想を上回る結果となったことや、失業保険申請件数で4週移動平均が14年ぶりの低水準となったことが好感され、ドルが主要通貨に対して堅調な動きとなった。また、欧米の株価が大きく上昇したことから、投資家のリスク志向の動きが強まり、安全資産とされる円を売る動きが優勢となった。しかし、終盤には、NY で新たなエボラ感染者の可能性との報道を受けて、株価が上げ幅を大きく縮小する動きとなり、ドル円・クロス円も下落する場面もあった。また、ユーロは、ドイツとユーロ圏の景況指数が市場予想を上回り、欧州経済に対する懸念が後退したとの見方から、主要通貨に対して堅調な動きとなった。

2014/10/23 (木)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	107.25	107.36	107.11
EUR/JPY	135.57	135.68	135.43
GBP/JPY	171.99	172.34	171.72
AUD/JPY	94.25	94.31	93.80
EUR/USD	1.2640	1.2652	1.2640

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	107.66	107.25
EUR/JPY	136.37	135.57
GBP/JPY	172.59	171.99
AUD/JPY	94.73	94.25
EUR/USD	1.2677	1.2640

*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	15138.96	-56.81
ハンセン指数	23333.18	-70.79
上海総合	2302.42	-24.14
韓国総合指数	1931.07	-5.32
豪ASX200	5383.13	-2.73
インドSENSEX指数	26851.05	+63.82
シンガポールST指数	3236.50	+33.76

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6419.15	+19.42
仏CAC40	4157.68	+52.59
独DAX	9047.31	+107.17
ST欧州600	328.29	+2.15
西IBEX35指数	1333.70	+83.80
伊FTSE MIB指数	19434.98	+168.73
南ア 全株指数	48104.66	-98.25

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	108.28	108.36	107.63
EUR/JPY	136.92	137.00	136.30
GBP/JPY	173.55	173.67	172.47
AUD/JPY	94.82	94.93	94.61
NZD/JPY	84.64	84.79	84.41
EUR/USD	1.2646	1.2672	1.2630
AUD/USD	0.8757	0.8799	0.8751

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	16677.90	+216.58
S&P500	1950.82	+23.71
NASDAQ	4452.79	+69.95
その他主要株	終値	前日比
カナダトロント総合	14486.83	+174.76
ブラジルボルサ指数	43691.06	+240.31
ロシアモスクワ指数	50713.26	-1697.77

10/24 経済指標スケジュール

14:00 【シンガポール】9月鉱工業生産
15:00 【独】11月GfK消費者信頼感調査
17:30 【英】3Q GDP
17:30 【英】8月サービス業指数
22:00 【メキシコ】経済活動GAE
23:00 【米】9月新築住宅販売件数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1229.10	-16.40
NY 原油	82.09	+1.57
CMEコーン	359.75	+6.75
CBOT 大豆	993.25	+30.50

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.39%	0.36%
3年債	0.82%	0.78%
5年債	1.49%	1.43%
7年債	1.94%	1.88%
10年債	2.28%	2.22%
30年債	3.05%	2.99%

10/24 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 107.64 ユーロ/円 136.37 ユーロ/ドル 1.2671

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	6380.02	-19.71	ダウ INDEX FUTURE	16543	+118
仏 CAC40	4119.61	+14.52	S&P500 FUTURE	1937.90	+12.80
独 DAX	8965.29	+25.15	NASDAQ FUTURE	3976.00	+26.75

(出所:SBILM)

《企業決算》

米 3 M

第 3 四半期 1 株利益 1.98 ドル (予想 1.96 ドル)

米 GM

第 3 四半期 調整後の 1 株利益は 0.97 ドル (予想 0.95 ドル)

米キャタピラー

第 3 四半期 調整後の 1 株利益は 1.72 ドル (予想 1.35 ドル)

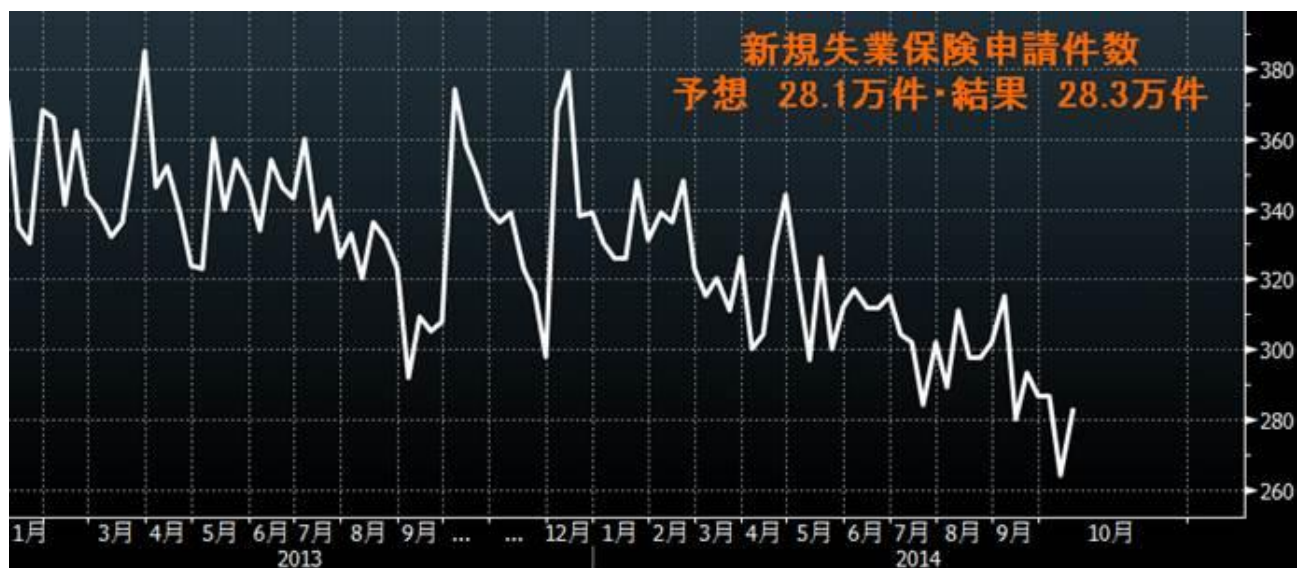
21:30

《 経済指標の結果 》

新規失業保険申請件数 28.3 万件 (予想 28.1 万件・前回 26.6 万件)

前回発表の 26.4 万件から 26.6 万件に修正

失業保険継続受給者数 235.1 万人 (予想 238.0 万人・前回 238.9 万人)



(出所:ブルームバーグ)



(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
14/10/18	283,000	・	+17,000	・	281,000	・	*****	・	*****
14/10/11	266,000	・	-21,000	・	284,000	・	2,351,000	・	1.8%
14/10/04	287,000	・	-1,000	・	287,750	・	2,389,000	・	1.8%
14/09/27	288,000	・	-7,000	・	295,000	・	2,382,000	・	1.8%
14/09/20	295,000	・	+14,000	・	299,000	・	2,402,000	・	1.8%
14/09/13	281,000	・	-35,000	・	299,750	・	2,442,000	・	1.8%
14/09/06	316,000	・	+12,000	・	304,250	・	2,432,000	・	1.8%
14/08/30	304,000	・	+6,000	・	303,250	・	2,492,000	・	1.9%
14/08/23	298,000	・	-1,000	・	299,750	・	2,478,000	・	1.9%
14/08/16	299,000	・	-13,000	・	301,000	・	2,528,000	・	1.9%
14/08/09	312,000	・	+22,000	・	296,000	・	2,502,000	・	1.9%
14/08/02	290,000	・	-13,000	・	293,750	・	2,549,000	・	1.9%

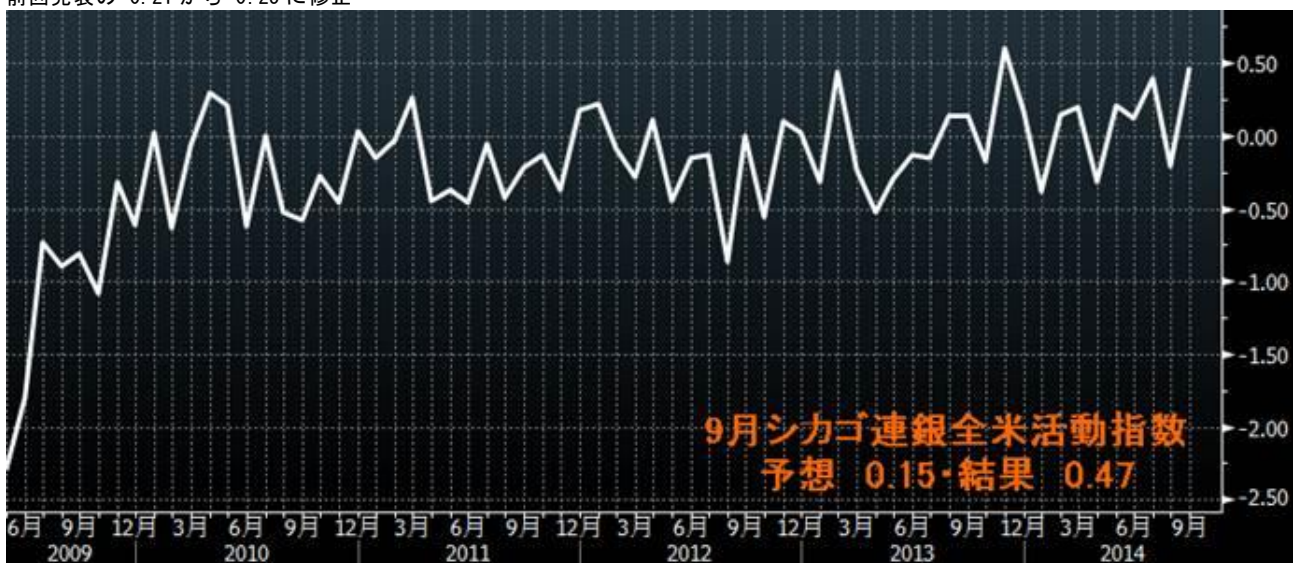
受給者数は集計が1週間遅れる

21:30

《 経済指標の結果 》

9月シカゴ連銀全米活動指数 0.47 (予想 0.15・前回 -0.25)

前回発表の-0.21から-0.25に修正



(出所:ブルームバーグ)

《シカゴ連備全米活動指数》

活動指數・・・0.47・・-0.25・・0.52・・0.20・・0.16・・0.15・・0.53

22 : 00

8月米住宅価格指数(前月比) 0.5%(予想 0.3%・前回 0.1%)



(出所:ブルームバーグ)

《 経済指標の結果 》

22 : 33

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	16629.71	+168.39
ナスダック	4429.09	+46.25

(出所: SBILM)

《 經濟指標の結果 》

10月マークイット米国製造業PMI
予想 57.0・結果 56.2

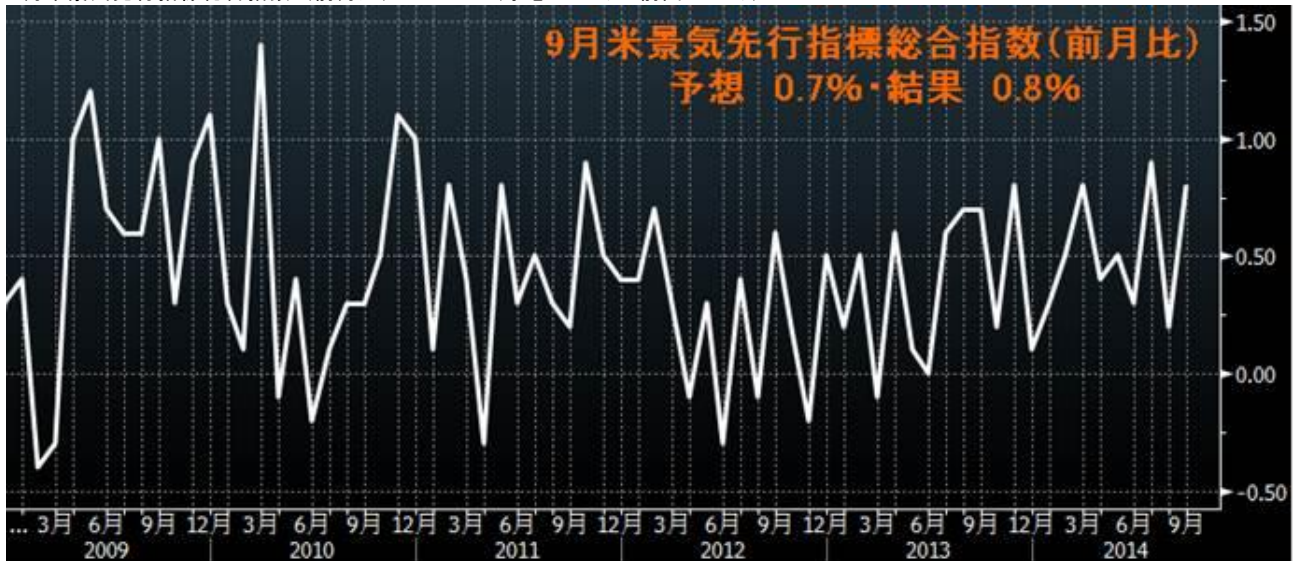
Month	PMI Value
2012年6月30日	52.5
2012年9月30日	51.5
2012年12月31日	53.5
2013年3月31日	54.5
2013年6月30日	52.5
2013年9月30日	53.0
2013年12月31日	54.5
2014年3月31日	55.5
2014年6月30日	57.5
2014年9月30日	58.0
2014年10月	56.2

(出所:ブルームバーグ)

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

9月米景気先行指標総合指数（前月比） 0.8%（予想 0.7%・前回 0.2%）



（出所：ブルームバーグ）

指標結果データ

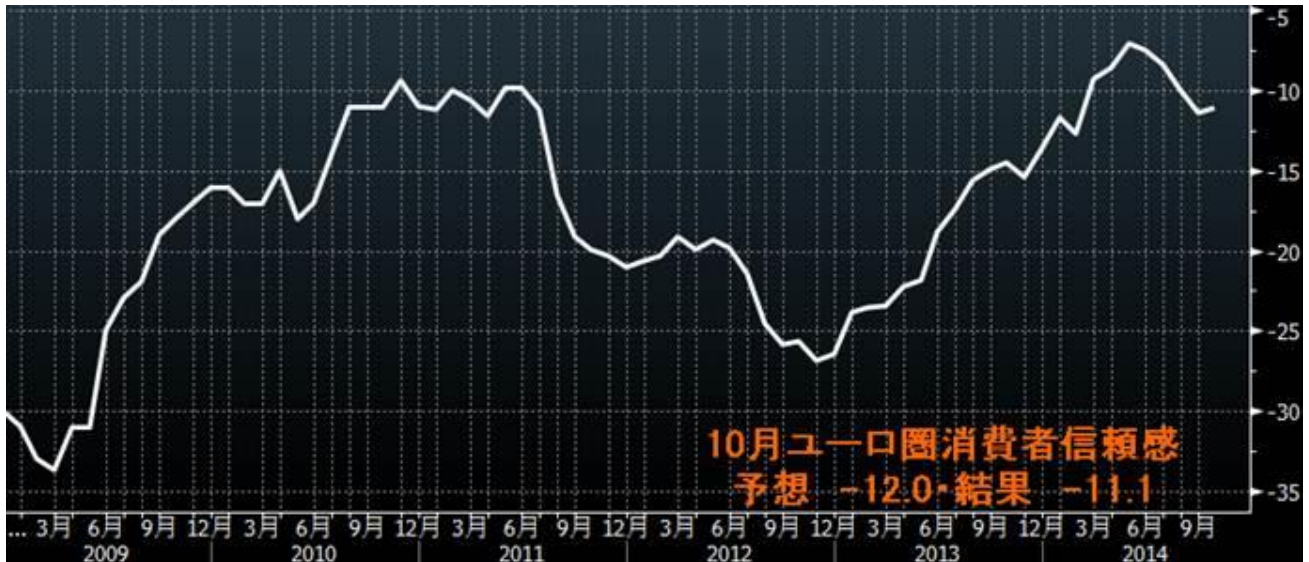
◀ 米景気先行指数 ▶

	9月	8月	7月	6月	5月	4月	3月
先行指数	0.8	0.0	1.1	0.7	0.6	0.3	1.0
一致指数	0.4	0.1	0.3	0.3	0.2	0.2	0.3
遅行指数	0.1	0.3	0.2	0.4	0.4	0.3	0.7

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

10月ユーロ圏消費者信頼感 -11.1（予想 -12.0・前回 -11.4）



（出所：ブルームバーグ）

指標結果データ

◀ ユーロ圏消費者信頼感指数 ▶

	10月	9月	8月	7月	6月	5月	4月
ユーロ圏消費者信頼感指数	-11.1	-11.4	-10.0	-8.4	-7.5	-7.1	-8.6

23:30

＜ NY 株式市場 序盤 ＞

序盤の株式市場は、堅調な企業決算が相次いだことから、米景気への慎重な見方が後退し買い安心感が広がったことから、主要株価は堅調な動きとなった。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 245 ドル高まで上昇する動きとなっている。

0:00

＜ 経済指標の結果 ＞

10 月カンザスシティ連銀製造業活動指数 4 (予想 6・前回 6)



(出所:ブルームバーグ)

＜ 経済指標のポイント ＞

(1) 米失業保険申請件数は、前週比+1.7 万件的の 28.3 万件的となり、市場予想の 28.2 万件的をやや上回った。申請件数の 4 週移動平均は、前週比-0.3 万件的の 28.1 万件的となり、2000 年 5 月 6 日までの週以来約 14 年 5 ヶ月ぶりの低水準となった。また、集計が 1 週遅れる失業保険継続受給者数は、前週比-3.8 万人の 235.1 万人となり、2000 年 12 月 23 日までの週以来の低水準となった。受給者総数の 4 週移動平均は、前週比-2 万 2750 人の 238.1 万人となり、2006 年 5 月 20 日までの週以来の少ない水準となった。受給者比率は、前週から横ばいの 1.8%となった。

(2) FHFA (米連邦住宅金融局) の発表した、8 月の住宅価格指数は、前月比+0.5%となり、市場予想の+0.3%上回る結果となった。前年比では+4.8%となった。地域別では、マサチューセッツ州やコネティカット州を含むニューイングランド地域が-0.6%、一方ニューヨーク、ニュージャージー、ペンシルベニアの各州を含む中部大西洋岸地域は+0.4%となった。

(3) 米大手民間調査機関の CB (コンファレンス・ボード) が発表した 9 月の景気先行指数は、前月比で+0.8%となり、市場予想の 0.7%を上回り、前回の 0.0%から上昇する結果となった。年内は、経済が堅調に成長する可能性を示し結果となった。構成する 10 系列のうち 9 系列がプラスに寄与。失業保険申請件数や製造業新規受注、長短金利スプレッドなどが寄与した。一致指数は+0.4% (前月+0.1%)、遅行指数は+0.1% (+0.3%) だった。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6419.15	+19.42
仏 CAC40	4157.68	+52.59
独 DAX	9047.31	+107.17
ストック欧州 600 指数	328.29	+2.15
ユーロファースト 300 指数	1317.28	+8.55
スペイン IBEX35 指数	10333.70	+83.80
イタリア FTSE MIB 指数	19434.98	+168.73
南ア アフリカ全株指数	48104.66	-98.25

(出所:SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、ドイツやユーロ圏の景況指標の改善を受けて買い安心感が広がった。また、米国株が大幅高で始まったことも好感され、主要株価は堅調な動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)

1 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 16715.67 (+254.35)、 S&P500 1953.76 (+26.65)、 ナスダック 4458.67 (+75.82)

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、世界景気の減速懸念が後退し、安全資産とされる米国債の売りが先行した。中国の 10 月の製造業購買担当者指数や、ユーロ圏の 10 月の PMI がともに前月から改善したほか、米失業保険申請数で失業保険受給者総数が 2000 年 12 月以来の低い水準に減少したことが材料視された。

午前の利回りは、30 年債が 3.04% (前日 2.99%)、10 年債が 2.27% (2.22%)、7 年債が 1.94% (1.88%)、5 年債が 1.49% (1.43%)、3 年債が 0.82% (0.77%)、2 年債が 0.39% (0.36%)。

《 欧州のポイント 》

①スペインの第 3・四半期の失業率は 23.7%と、第 2・四半期の 24.5%から低下した。これは 2011 年第 4・四半期以来、約 3 年ぶりの低水準となった。スペインの第 3・四半期 GDP は、前期比+0.5%となり、第 2・四半期の+0.6%からやや減速したことになる。スペイン中銀は、2014 年の経済成長率は 1.3%、2015 年は 2.0%との見通しを示した。ただ、世界経済の見通し悪化を背景にここ数カ月で予想に対する下方リスクが増大したとの見解を示した。

②ノルウェー中銀は、政策金利を予想通り 1.50%に据え置いた。政策金利は 2012 年 3 月から据え置いている。経済の見通しは悪化したと指摘しており、利上げの時期が後ずれしたのではないかと憶測が浮上した。ノルウェー中銀は「先行きの情勢に関する不透明感が、特にユーロ圏で強まっている」と指摘。「予想される海外主要金利の引き上げは、再び先送りされた」とした。また、オルセン総裁は、海外情勢や原油安もノルウェー経済の先行きに関する不透明感を強めたと付け加えた。

③英中銀副総裁は、中立的な金利水準についての市場の見方は妥当との見解を示した。国内の実質中立金利については「今後しばらくは低位で安定するが、将来的には、経済成長の阻害要因が解消され、上昇する可能性が高い」との認識を示した。また、利上げは緩やかなペースで進めると語った。中立金利の水準が現時点でプラス圏にあるか聞かれ、インフレ調整後は恐らくマイナス圏にあると述べた。具体的な数値は示さなかった。

④トルコ中銀は、市場予想通り主要政策金利の 1 週間物レポレート を 8.25%、翌日物貸出金利を 11.25%、プライマリーディーラーの翌日物借入金利を 10.75%、通常の翌日物借入金利を 7.50%にそれぞれ据え置いた。そして、インフレ期待を注視し、明確な改善が見られるまで金融政策を引き締め続ける方針を示した。

3 : 30

NY 金は、中心限月が前日比 16.40 ドル安の 1 オンス=1229.10 ドルで取引を終了した。

4 : 15

NY 原油は、中心限月が前日比 1.57 ドル高の 1 バレル=82.09 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1229.10	-16.40
NY 原油	82.09	+1.57

(出所:SBILM)

《 NY 金市場 》

NY 金は、中国やユーロ圏の製造業関連の景況指標が改善したほか、米国で主要企業の好調な四半期決算が相次いだことから世界景気の先行き懸念が後退し、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。



(出所:ブルームバーグ)

《 NY 原油市場 》

NY 原油は、サウジアラビアの原油生産が増加傾向にある一方、9月の市場への供給量は前月から減少したとの報道を受けて、供給過剰感が後退し、買いが優勢となった。欧米株の上昇で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	16677.90	+216.58	16767.52	16468
S&P500 種	1950.82	+23.71	1961.95	1931.02
ナスダック	4452.79	+69.95	4475.55	4421.56

(出所: SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、堅調な企業決算が相次いだことから、米景気への慎重な見方が後退し買い安心感が広がったことから、主要株価は堅調な動きとなった。主要株価は大幅上昇となったものの、終盤には NY で新たなエボラ感染者の可能性との報道を受けて上げ幅を縮小する動きとなった。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 306 ドル高まで上昇する動きとなったものの、終盤には上げ幅を縮小する動きとなった。



(出所: ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	108.28	108.36	107.63
EUR/JPY	136.92	137.00	136.30
GBP/JPY	173.55	173.67	172.47
AUD/JPY	94.82	94.93	94.61
NZD/JPY	84.64	84.79	84.41
EUR/USD	1.2646	1.2672	1.2630
AUD/USD	0.8757	0.8799	0.8751

(出所: SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、欧米の経済指標が堅調な結果となったことや、株価が大きく上昇したことを受けて、世界的な景気先行き懸念が後退し、安全資産とされる円が売られる動きとなった。ドル円・クロス円は終盤まで堅調な動きとなった。ただ、終盤には株価が上げ幅を縮小したことから、ドル円・クロス円も下げる場面もあった。



(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。