

NYマーケットレポート（2014年10月24日）

NY市場では、序盤に発表された9月の米新築住宅販売件数が2008年7月以来の高水準となったものの、6年ぶりの高水準となった前回の結果が大きく下方修正されたことを嫌気して、ドルは主要通貨に対して下落する動きとなった。一方、欧州の主要銀行に対するストレステストで、25行程度が資本不足となると報じられたことを受けて、ユーロが主要通貨に対して下落する動きとなった。しかし、ECBが「結果が確定（26日）するまでは単なる臆測にすぎない」とコメントしたことを受けて、値を戻す動きとなった。その後は、堅調な株価動向を背景に、ドル円・クロス円は終盤まで堅調な展開が続いた。

2014/10/24（金）

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	108.24	108.32	107.87
EUR/JPY	136.82	136.96	136.53
GBP/JPY	137.53	173.65	172.98
AUD/JPY	94.88	94.90	94.12
EUR/USD	1.2642	1.2662	1.2638

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	108.24	107.95
EUR/JPY	136.96	136.67
GBP/JPY	173.92	173.21
AUD/JPY	94.99	94.77
EUR/USD	1.2664	1.2638

*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	15291.64	+152.68
ハンセン指数	23302.20	-30.98
上海総合	2302.28	-0.14
韓国総合指数	1925.69	-5.96
豪ASX200	5412.25	+29.11
インドSENSEX指数	26851.05	+63.82
シンガポールST指数	3222.55	-13.95

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6388.73	-30.42
仏CAC40	4128.90	-28.78
独DAX	8987.80	-59.51
ST欧州600	327.17	-1.09
西IBEX35指数	10339.30	+5.60
伊FTSE MIB指数	19495.68	+60.70
南ア 全株指数	47879.45	-225.21

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	108.14	108.19	107.79
EUR/JPY	137.00	137.07	136.50
GBP/JPY	173.98	174.03	173.19
AUD/JPY	95.13	95.28	94.82
NZD/JPY	84.97	85.06	84.72
EUR/USD	1.2670	1.2696	1.2647
AUD/USD	0.8797	0.8825	0.8780

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	16805.41	+127.51
S&P500	1964.58	+13.76
NASDAQ	4483.71	+30.92
その他主要株	終値	前日比
🇨🇦 トロント総合	14543.82	+56.99
🇧🇷 ボルサ指数	43665.54	-25.52
🇲🇽 ボベスパ指数	51940.73	+1227.47

10/27 経済指標スケジュール	
08:50	【日】9月企業向けサービス価格指数
17:30	【香港】9月貿易収支
18:00	【独】10月IFO【景気動向】
18:00	【欧】9月マネーサプライM3
21:30	【トルコ】設備稼働率
22:45	【米】10月マークイット米国サービス業PMI
23:00	【米】9月中古住宅販売成約
23:00	【メキシコ】9月貿易収支
23:30	【米】10月ダラス連銀製造業活動指数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1231.80	+2.70
NY 原油	81.01	-1.08
CME コーン	353.00	-6.75
CBOT 大豆	977.50	-15.75

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.38%	0.39%
3年債	0.81%	0.82%
5年債	1.49%	1.49%
7年債	1.93%	1.94%
10年債	2.26%	2.28%
30年債	3.03%	3.05%

10/27 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 107.95 ユーロ/円 136.67 ユーロ/ドル 1.2652

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	6392.23	-26.92	ダウ INDEX FUTURE	16569	-44
仏 CAC40	4132.52	-25.16	S&P500 FUTURE	1938.90	-7.20
独 DAX	8994.97	-52.34	NASDAQ FUTURE	3989.50	-15.75

(出所:SBILM)

《企業決算》

米 UPS

第3四半期 1株利益 1.32ドル (予想 1.28ドル)

米フォード

第3四半期 調整後の1株利益は 0.24ドル (予想 0.19ドル)

米 P&G

第3四半期中核的1株利益は 1.07ドル (予想 1.07ドル)

21:45

ECBの銀行審査で25行が不合格～発表文草稿

22:00

《経済指標の結果》

8月メキシコ経済活動GAE 1.29% (予想 2.30%・前回 2.52%)



(出所:ブルームバーグ)

22 : 34

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	16690.14	+12.24
ナスダック	4457.63	+4.84

(出所:SBILM)

《ポイント》

ECBがユーロ圏の銀行を対象に実施してきた包括的審査で、25行が不合格になる。最終結果発表声明の草稿から分かった。この文書によれば、105行は合格。不合格の銀行のうち10行程度が、依然として資本不足に陥っていると関係者が明らかにした。関係者によれば、最終結果が26日に公表されるまでに数字はまだ変わる可能性が高い。

ECBは「包括的審査の結果についての臆測に関してコメントできない」とし、「最終結果に関するいかなる推量も、結果が確定するまでは単なる臆測にすぎない」との声明を出した。

審査で資本不足が判明しても、今年に入ってから十分な資本を調達している銀行には追加調達の必要はない。現時点でも不足が続いている銀行は2週間以内に資本計画を提出しなければならない。銀行が最終結果についてECBと同意する期限は25日。

23 : 00

《 経済指標の結果 》

9月米新築住宅販売件数 46.7万件（予想 47.0万件・前回 46.6万件）
 前回発表の50.4万件から46.6万件に修正

9月米新築住宅販売件数（前月比） 0.2%（予想 -6.8%・前回 15.3%）
 前回発表の18.0%から15.3%に修正



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

《新築住宅販売》

	9月	8月	7月	6月	5月	4月
販売戸数	46.7	46.6	40.4	40.9	45.8	41.3
前月比 (%)	0.2	15.3	-1.2	-10.7	10.9	2.5
	(万件)					
	9月	8月	7月	6月	5月	4月
北東部	3.0	3.0	2.1	2.6	3.7	2.1
中西部	6.4	5.7	5.7	5.4	7.5	6.5
南部	26.1	25.6	23.0	22.8	23.7	23.4
西部	11.2	12.3	9.6	10.1	10.9	9.3
	(万件)					

23 : 30

＜ NY 株式市場 序盤 ＞

序盤の株式市場は、決算発表で好業績だった銘柄を中心に買われる一方、エボラ出血熱の感染拡大の影響を懸念した売りも出ており、主要株価は序盤から売り買いが交錯するもみ合いの展開が続いている。

23 : 50

報道官

- ・「ECB 総裁は、必要に応じ他の非標準的手段利用の用意があるとあらためて表明」
- ・「低インフレの長期化で賃金・物価設定に二次的な影響及べば懸念」

＜ 経済指標のポイント ＞

9 月の米新築住宅販売件数は、年率換算で前月比+0.2%の 46.7 万件となり、2008 年 7 月以来の高水準となった。前年同月比は +17.0%となった。

①市場に出て売れ残った住宅在庫は、9 月末時点で前月比+1.5%の 20.7 万件、販売に対する在庫率は 5.3 カ月と前月から横ばいとなり、適正水準とされる 6.0 カ月を下回った。

②販売物件の中間価格は、前月比-9.7%の 25.9 万ドルと、2010 年 10 月以来の大きな下落率。前年同月比では-4.0%となった。平均価格は、前月比-10.3%の 31 万 3200 ドルと、下落率は 2008 年 8 月以来の大きさととなった。前年同月比では-2.6%となった。

③地域別では、最大市場の南部が+2.0%、中西部は+12.3%、北東部は横ばい、西部は-8.9%となった。

0 : 40

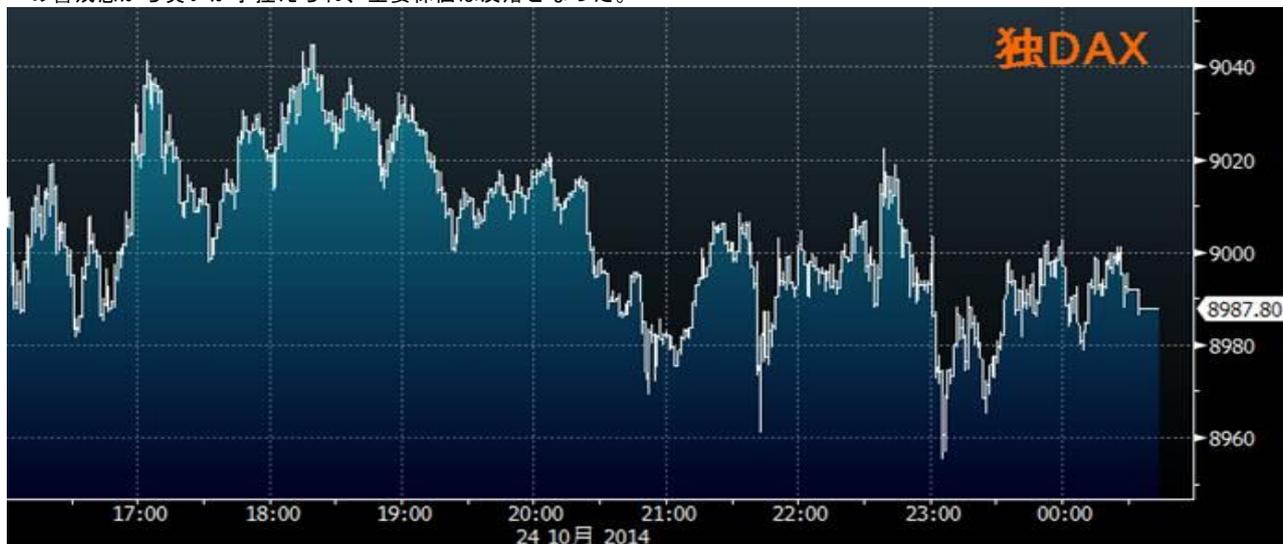
キプロスを「B+」に格上げ、見通しをステータブルに変更～米格付け会社

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6388.73	-30.42
仏 CAC40	4128.90	-28.78
独 DAX	8987.80	-59.51
ストック欧州 600 指数	327.17	-1.09
ユーロファースト 300 指数	1312.74	-4.54
スペイン IBEX35 指数	10339.30	+5.60
イタリア FTSE MIB 指数	19495.68	+60.70
南ア アフリカ全株指数	47879.45	-225.21

(出所:SBILM)

＜ 欧州株式市場 ＞

欧州株式市場は、26 日発表のユーロ圏主要銀行の資産査定と健全性審査（ストレステスト）の結果や、エボラ出血熱の感染拡大への警戒感から買いが手控えられ、主要株価は反落となった。



(出所:ブルームバーグ)

1 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 16765.91 (+88.01)、 S&P500 1961.05 (+10.23)、 ナスダック 4470.07 (+17.28)

1:00

◀ 経済指標の結果 ▶

9月仏求職者数合計 343.3万人 (予想 341.9万人・前回 341.3万人)



1:05

ロシアの格付け維持、見通しは引き続きネガティブ～米格付け会社

◀ 欧州のポイント ▶

①英政府統計局が発表した第3四半期のGDP速報値は、前期比+0.7%となり、第2四半期の+0.9%から鈍化した。ユーロ圏の低迷の影響などもあり、プラス成長となったものの、そのペースは減速した。また、サービス業の成長率は+0.7%と、前期の+1.1%から鈍化した。英中銀の当局者らは、低調なユーロ圏からの英経済への影響について懸念を深めている。

②欧州委員会のカタイン委員、ドイツの潜在成長率は低過ぎるため、投資を拡大する必要があるとの見方を示した。カタイン氏は、11月1日発足の新体制の欧州委で雇用・成長・投資・競争政策担当副委員長に就任する。カタイン氏は、イタリアの2015年予算案について、同国政府から追加情報が必要だと述べた。欧州委はイタリアに対し、財政赤字削減の約束がなぜ守れていないのかについて説明を求めている。

③ECBによると、ユーロ圏の銀行は来週29日に3年物流動性供給オペ(LTRO)資金56億6100万ユーロを返済する。返済額は今週の58億ユーロをやや下回った。また、市場予想の45億ユーロは上回った。内訳は、LTRO第1弾から3行が3億ユーロ、第2弾から9行が53億6000万ユーロ。

◀ NY債券市場・午前 ▶

序盤のニューヨーク債券市場は、米ニューヨークでエボラ出血熱の感染者が出たことの影響が懸念され、長期債を中心に安全資産とされる米国債の逃避買いが先行した。また、9月の米新築住宅販売数が予想を下回ったことも、支援材料となった。ただ、その後は米国株の上昇につれて売りが出る場面もあり、上げ幅は縮小した。

午前の利回りは、30年債が3.03% (前日3.05%)、10年債が2.26% (2.28%)、7年債が1.93% (1.94%)、5年債が1.49% (1.49%)、3年債が0.82% (0.82%)、2年債が0.39% (0.39%)。

3:40

NY金は、中心限月が前日比2.70ドル高の1オンス=1231.80ドルで取引を終了した。

4:10

NY原油は、中心限月が前日比1.08ドル安の1バレル=81.01ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1231.80	+2.70
NY 原油	81.01	-1.08

(出所:SBILM)

◀ NY 金市場 ▶

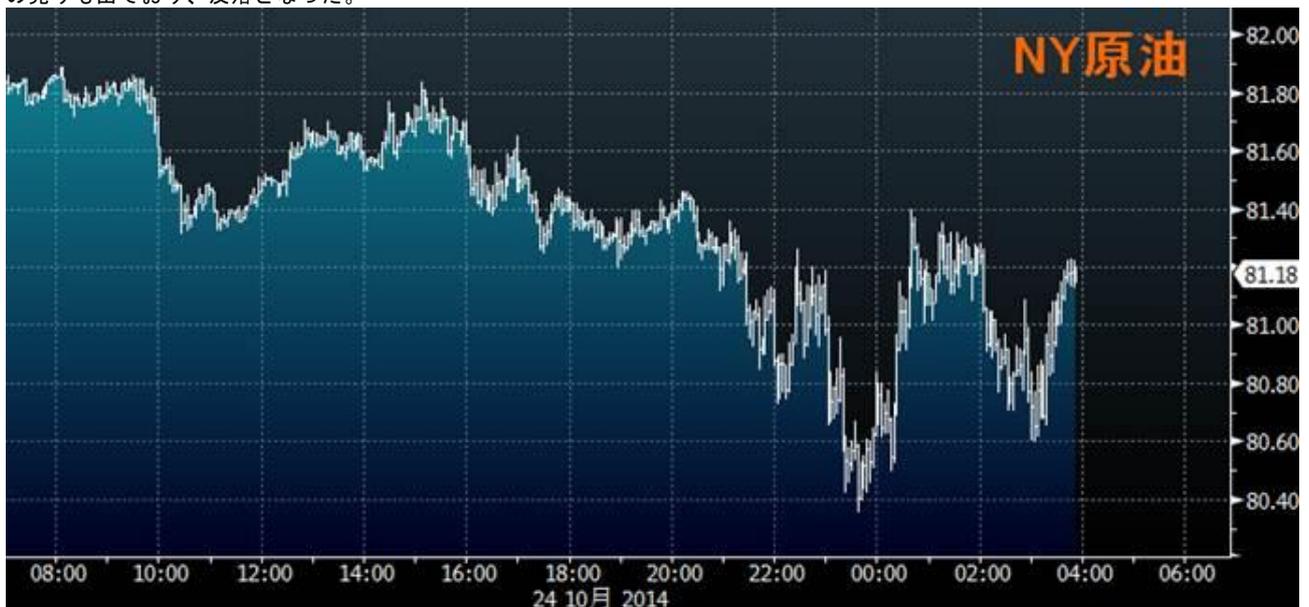
NY 金は、ドルが主要通貨に対して下落したことからドル建てに割安感が広がり、買いが優勢となった。ただ、米国株の上昇につれて比較的安全な資産とされる金を売る動きも出て、やや上値の重い動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)

◀ NY 原油市場 ▶

NY 原油は、世界的な供給過剰への警戒感が根強く、売りが優勢となった。前日の相場上昇を受けて、一旦利益を確定するための売りも出ており、反落となった。



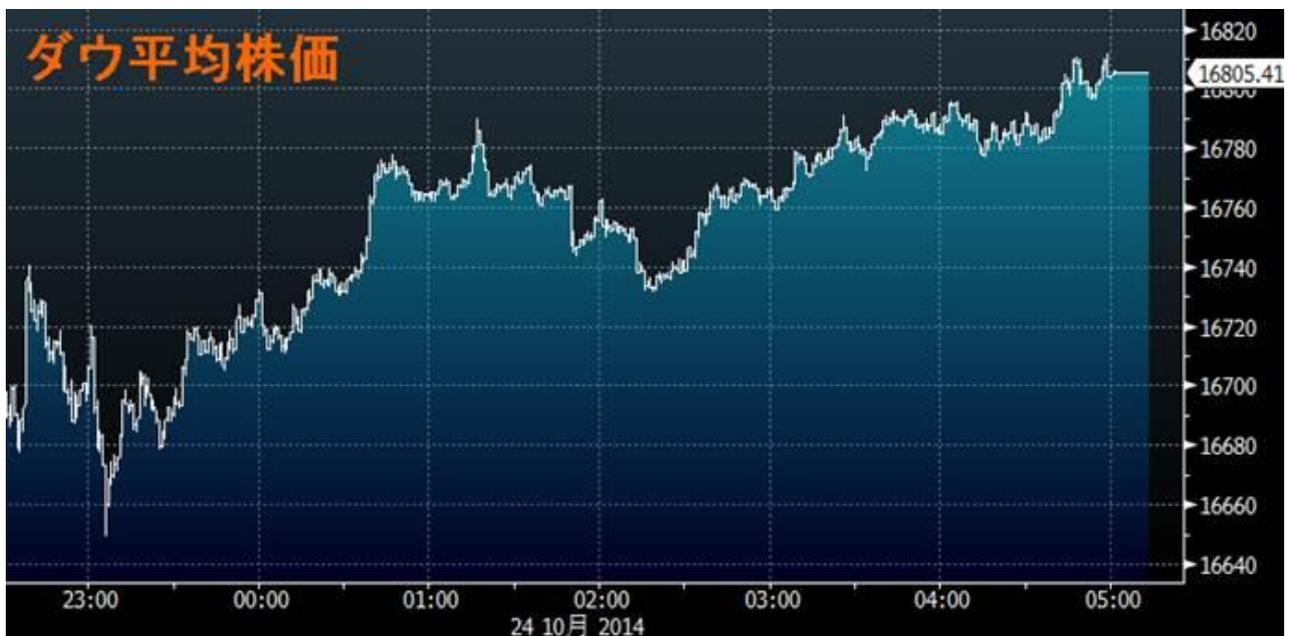
(出所:ブルームバーグ)

主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	16805.41	+127.51	16811.71	16649.72
S&P500 種	1964.58	+13.76	1965.27	1946.27
ナスダック	4483.71	+30.92	4486.26	4445.85

(出所:SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、決算発表で好業績だった銘柄を中心に買われる一方、エボラ出血熱の感染拡大の影響を懸念した売りも出ており、序盤の主要株価は売り買いが交錯するもみ合いの展開となった。しかし、その後は堅調な展開が終盤まで続いた。



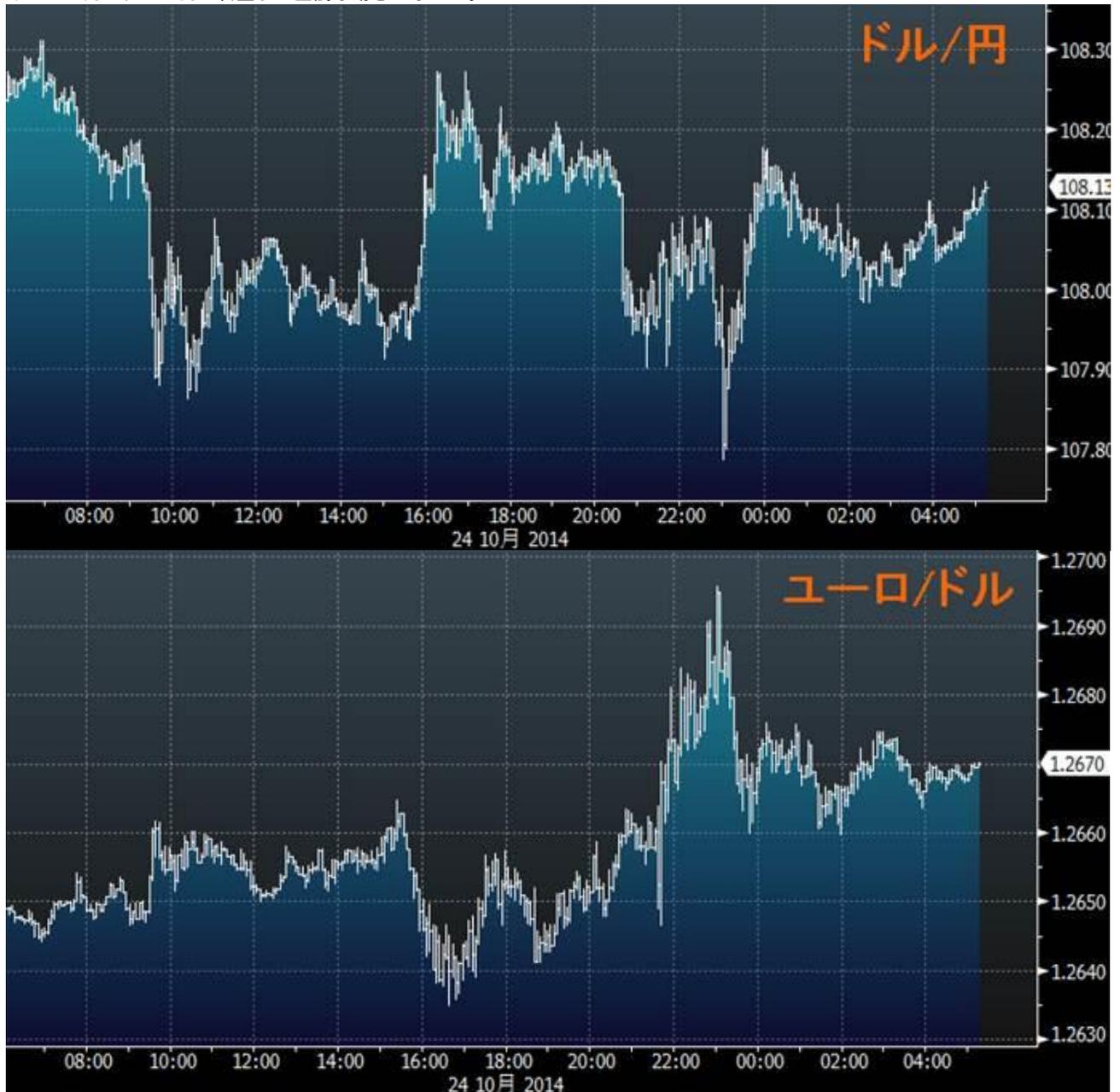
(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	108.14	108.19	107.79
EUR/JPY	137.00	137.07	136.50
GBP/JPY	173.98	174.03	173.19
AUD/JPY	95.13	95.28	94.82
NZD/JPY	84.97	85.06	84.72
EUR/USD	1.2670	1.2696	1.2647
AUD/USD	0.8797	0.8825	0.8780

(出所:SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、序盤に、欧州銀行に対するストレステストで25行が不合格になるとの報道を受けて、ユーロが主要通貨に対して下落する動きとなった。しかし、ECBが否定するコメントをしたことを受けて値を戻す動きとなった。また、米住宅関連の経済指標が予想を下回る結果となったことを受けて、ドルも主要通貨に対して下げる動きとなった。そして、堅調な米株価動向を受けてドル円・クロス円は終盤まで堅調な動きとなった。



(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。