

NYマーケットレポート (2014年11月28日)

NY市場では、前日にOPEC(石油輸出国機構)が生産目標の据え置きを決定したことが引き続き材料視され、原油安が米経済を下支えとの見方から、ドルが主要通貨に対して堅調な動きとなった。一方、商品価格の下落が石油産油国や資源国経済を圧迫するとの見方から、豪ドルやノルウェー・クローネ、カナダ・ドル、ロシア・ルーブル、ブラジル・リアルなどが軟調な動きとなった。ただ、米国の感謝祭明けで株式市場などが短縮取引となったことで、取引材料に乏しく、値動きは限定的となった。

2014/11/28 (金)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	118.23	118.34	117.73
EUR/JPY	147.06	147.31	146.76
GBP/JPY	185.45	185.91	185.22
AUD/JPY	100.39	100.72	100.37
EUR/USD	1.2440	1.2468	1.2445

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	118.31	118.09
EUR/JPY	147.67	146.88
GBP/JPY	185.81	185.31
AUD/JPY	100.81	100.37
EUR/USD	1.2491	1.2430

*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	17459.85	+211.35
ハンセン指数	23987.45	-16.83
上海総合	2682.83	+52.35
韓国総合指数	1980.78	-1.31
豪ASX200	5323.00	-87.92
インドSENSEX指数	28693.99	+255.08
シンガポールST指数	3350.50	+9.54

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6722.62	-0.80
仏CAC40	4390.18	+7.84
独DAX	9980.85	+5.98
ST欧州600	247.25	-0.24
西IBEX35指数	10770.70	+43.10
伊FTSE MIB指数	20014.82	-85.71
南ア 全株指数	49911.37	-646.46

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	118.69	118.78	118.25
EUR/JPY	147.73	147.97	147.50
GBP/JPY	185.65	185.92	185.24
AUD/JPY	100.96	101.34	100.69
NZD/JPY	93.03	93.29	92.86
EUR/USD	1.2446	1.2490	1.2427
AUD/USD	0.8506	0.8539	0.8499

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17828.24	+0.49
S&P500	2067.56	-5.27
NASDAQ	4791.63	+4.31
その他主要株	終値	前日比
🇨🇦 トロント総合	14744.70	-177.74
🇧🇷 ボルサ指数	44190.47	-498.74
🇨🇵 ポベスパ指数	54664.36	-56.96

12/1 経済指標スケジュール

08:50	【日】3Q法人季報設備投資
09:30	【豪】3Q企業営業利益
10:00	【中】11月製造業PMI
10:45	【中】11月HSBC製造業PMI
14:00	【日】11月自動車販売台数
17:30	【香港】10月小売売上高
17:30 ~ 18:30	【スイス】【仏】【独】【欧】【英】11月製造業PMI
18:00	【南ア】11月カギンPMI
18:30	【英】10月マネーサプライM4
18:30	【英】10月住宅ローン承認件数
18:30	【英】10月消費者信用残高
00:00	【米】11月ISM製造業景況指数
00:00	【米】10月建設支出

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1175.50	-22.00
NY 原油	66.15	-7.54
CMEコーン	388.75	-2.75
CBOT 大豆	1016.00	-31.00

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.47%	0.52%
3年債	0.85%	0.91%
5年債	1.48%	1.56%
7年債	1.88%	1.95%
10年債	2.16%	2.24%
30年債	2.89%	2.95%

12/1 主要会議・講演・その他予定

(出所:SBILM)

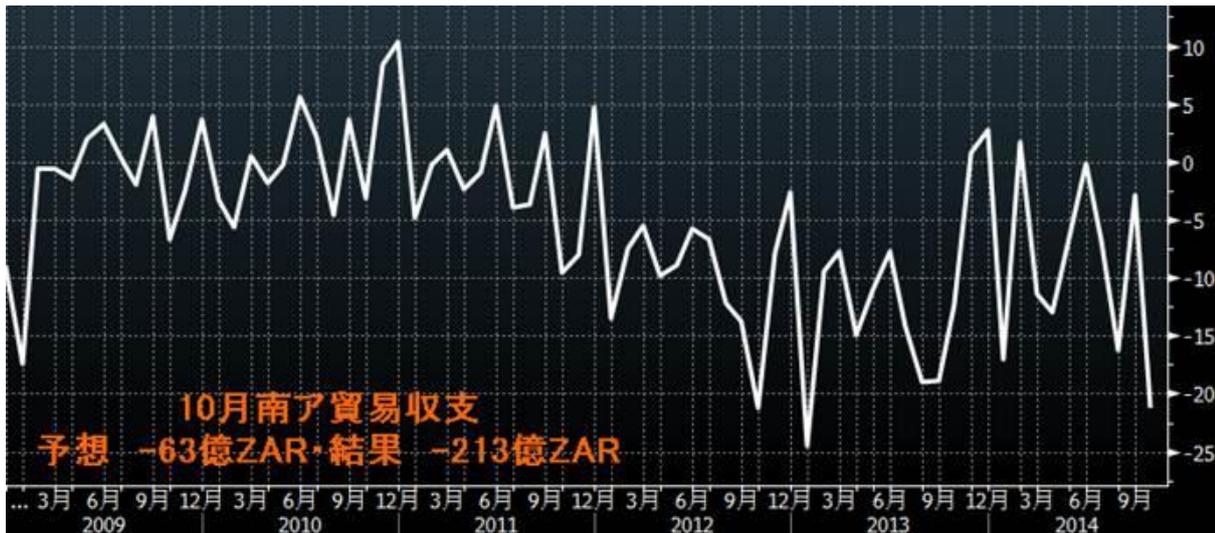
NY 市場レポート

欧州タイム

21 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

10月南ア貿易収支 -213億 ZAR (予想 -63億 ZAR・前回 -29億 ZAR)

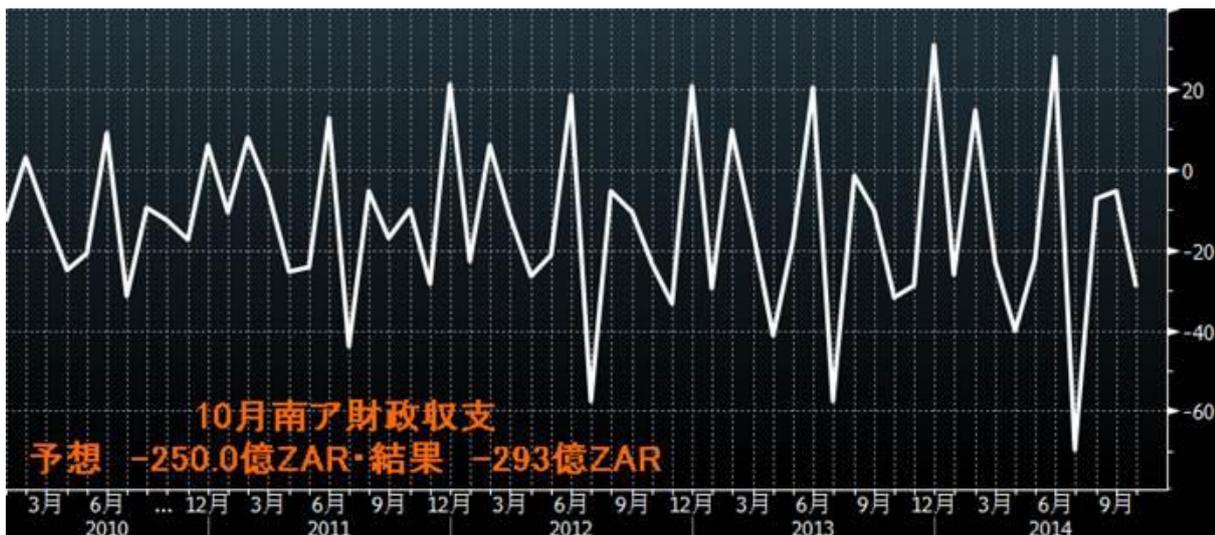


(出所:ブルームバーグ)

21 : 16

◀ 経済指標の結果 ▶

10月南ア財政収支 -293億 ZAR (予想 -250.0億 ZAR・前回 -53.6億 ZAR)



(出所:ブルームバーグ)

22:00

ドル/円 118.28 ユーロ/円 147.63 ユーロ/ドル 1.2482

22:00

欧州株式市場・米株価指数先物

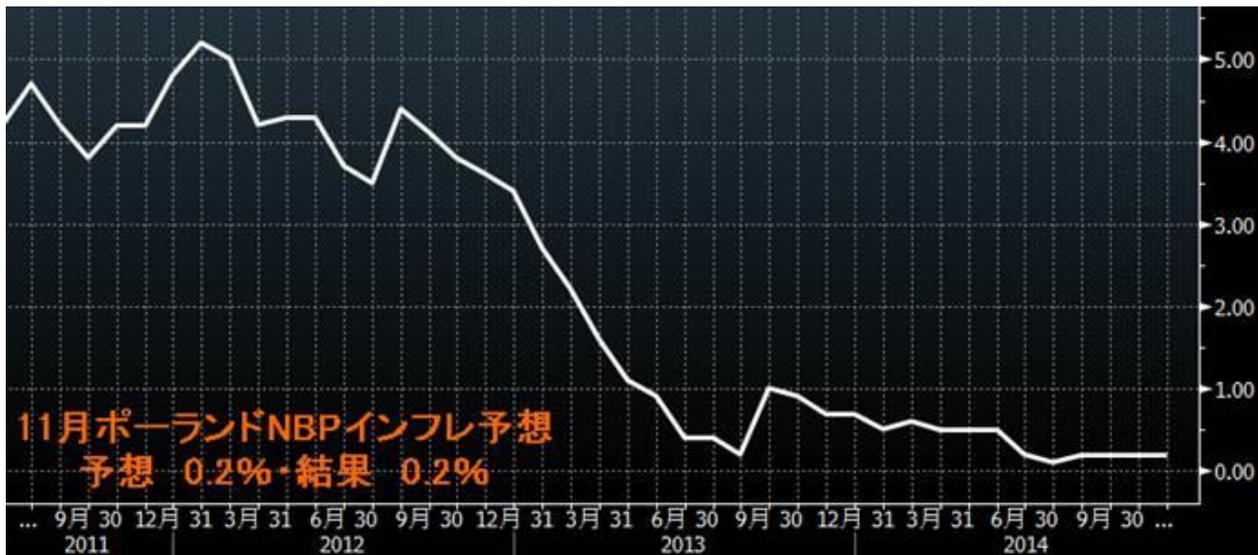
欧州主要株価	株価	前日比	米株価先物	株価	前日比
英 FT100	6696.90	-26.52	ダウ INDEX FUTURE	17807	-3
仏 CAC40	4368.78	-13.56	S&P500 FUTURE	2070.10	-2.20
独 DAX	9942.56	-32.31	NASDAQ FUTURE	4328.50	+10.75

(出所:SBILM)

22:00

◀ 経済指標の結果 ▶

11月ポーランドNBPインフレ予想 0.2% (予想 0.2%・前回 0.2%)



(出所:ブルームバーグ)

22:30

◀ 経済指標の結果 ▶

9月カナダGDP(前月比) 0.4% (予想 0.4%・前回 -0.1%)

3QカナダGDP(前期比年率) 2.8% (予想 2.1%・前回 3.6%)

前回発表の3.1%から3.6%に修正



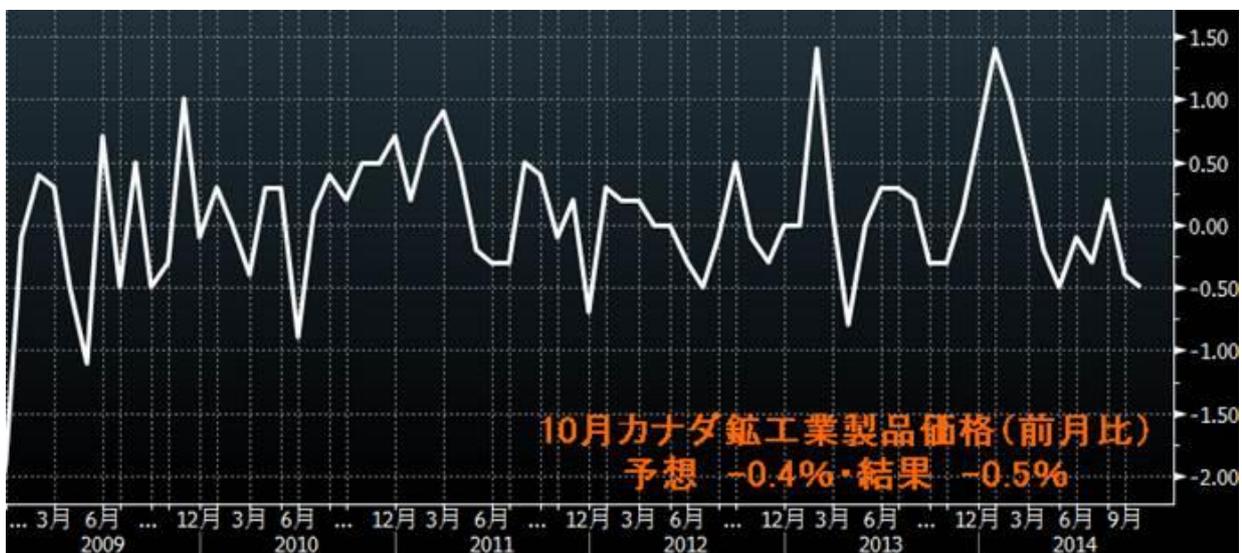
(出所:ブルームバーグ)

22 : 30

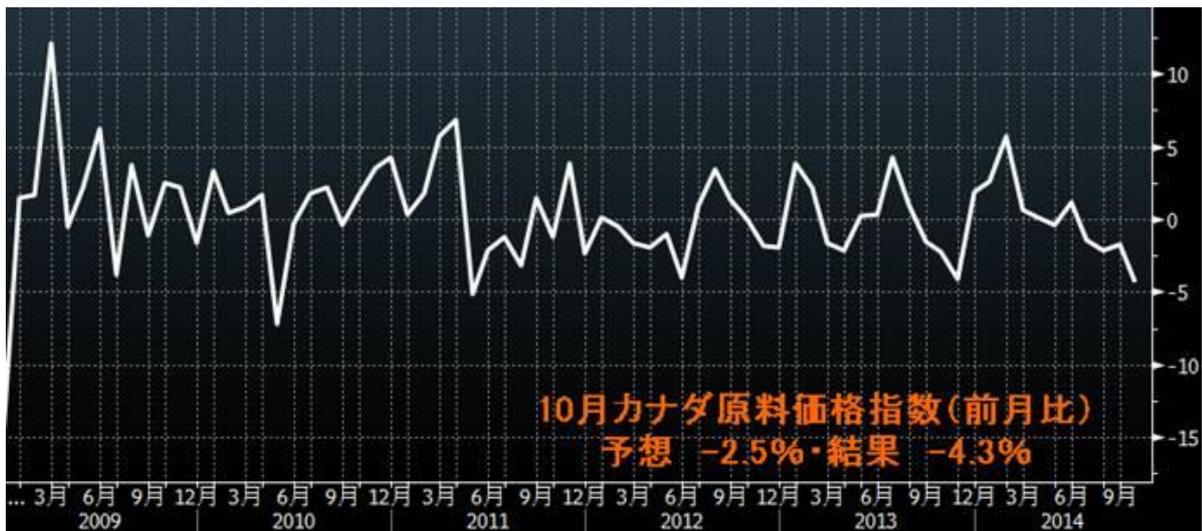
◀ 経済指標の結果 ▶

10月カナダ鉱工業製品価格(前月比) -0.5% (予想 -0.4%・前回 -0.3%)
 前回発表の-0.4%から-0.3%に修正

10月カナダ原料価格指数(前月比) -4.3% (予想 -2.5%・前回 -2.1%)
 前回発表の-1.8%から-2.1%に修正



(出所:ブルームバーグ)



(出所:ブルームバーグ)

23 : 33

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17863.56	+35.81
ナスダック	4793.46	+6.14

(出所:SBILM)

23 : 55

ロシアの期間5年CDSが314bpに上昇、3年ぶり高水準~マークイット

0 : 30

≪ NY 株式市場 序盤 ≫

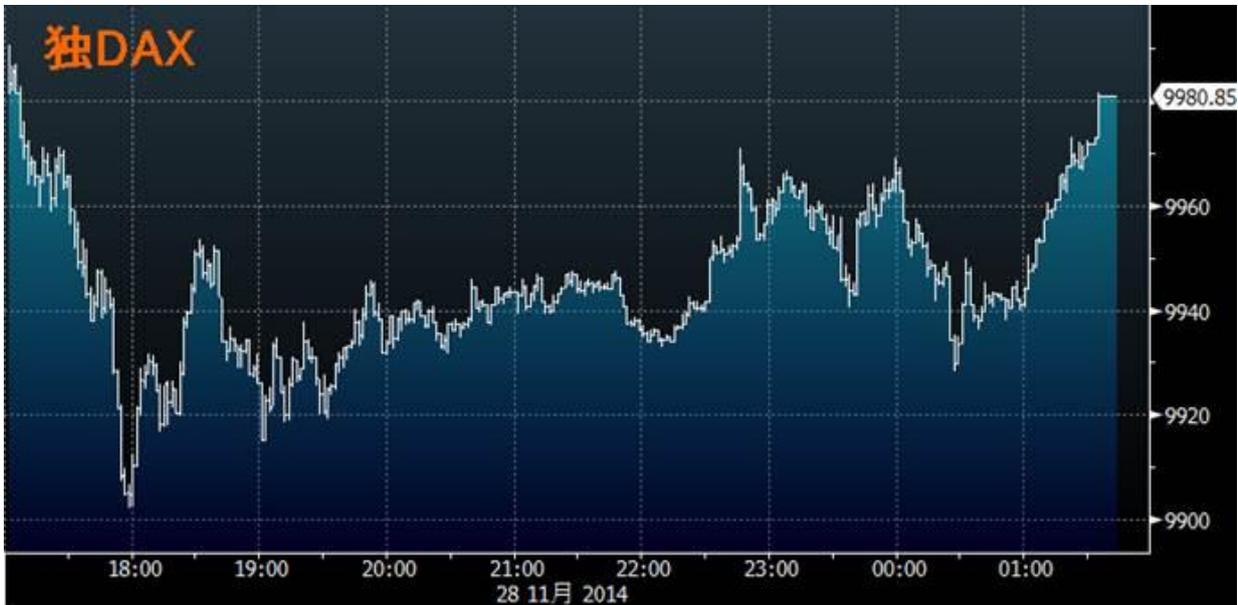
序盤の株式市場は、米国の年末商戦は好調との思惑から、ウォルマート・ストアーズなどの小売り関連株を中心に買いが集まった。ただ、OPEC（石油輸出国機構）の減産見送りを受けて石油関連株が売られるなど、やや上値の重い動きも見られている。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6722.62	-0.80
仏 CAC40	4390.18	+7.84
独 DAX	9980.85	+5.98
ストック欧州 600 指数	247.25	-0.24
ユーロファースト 300 指数	1392.70	+0.30
スペイン IBEX35 指数	10770.70	+43.10
イタリア FTSE MIB 指数	20014.82	-85.71
南ア アフリカ全株指数	49911.37	-646.46

(出所:SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、まちまちの結果となった。英 FT100 は、原油価格の先安観から石油関連株が売られ、小幅安となった。一方、独 DAX は、ECB による追加金融緩和への期待が支援材料となり、小幅高のとなった。



(出所:ブルームバーグ)

2 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 17861.12 (+33.37)、 S&P500 2071.67 (-1.16)、 ナスダック 4800.34 (+13.02)

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、OPEC（石油輸出国機構）の減産見送りを受けて原油価格が大幅下落したほか、ユーロ圏の11月消費者物価指数の上昇率が前月から縮小したことを手掛かりに、世界的に低インフレの状態が続くとの見方が広がり、買いが先行した。感謝祭の休日と週末の谷間で市場参加者が少なく、売買は低調だった。

午前の利回りは、30年債が2.91%（26日2.95%）、10年債が2.20%（2.24%）、7年債が1.92%（1.95%）、5年債が1.53%（1.56%）、3年債が0.89%（0.91%）、2年債が0.50%（0.52%）。

《 欧州のポイント 》

①ユーロ圏の16カ国の予算案の審査結果を発表。フランスとイタリア政府に、赤字縮小と経済の競争力強化に向けた一段の努力を求めた。また、ベルギーは、構造的赤字の解消に向けて「幾分の進展」があったと認めた上でさらなる行動を求めた。欧州委は、この3カ国について、制裁を科すかどうかを来年3月に決定する。EUは、財政赤字をGDPの3%まで、債務を60%までに抑えることを条約で定めており、これに反する国には最大でGDPの0.5%相当の制裁金が科される決まりだが、今までに制裁を受けた国はない。

②ユーロ圏の銀行は、来週12月3日に3年物流動性供給オペ（LTRO）資金58億6400万ユーロ（73億ドル）を返済する。返済額は、今週の85億ユーロを下回るが、市場予想の45億ユーロは上回る。内訳は、LTRO第1弾から8行が17億9300万ユーロ、第2弾から14行が40億7200万ユーロ。

③中銀が発表した企業調査によると、過去3ヵ月間の生産の伸びは8月時点の予想を下回り、先行き見通しも若干悪化となった。原油価格の急落が影響している。一方、10月の小売売上高は前月比+0.6%と市場予想を上回り、消費者信頼感指数は11月に上昇した。

④ポーランドの統計局は、第4・四半期 GDP 伸び率が第3・四半期並みになるとの見通しを示した。統計局幹部は「内需、投資、雇用など第3・四半期の好ましい流れが第4・四半期も続く」と指摘。「比較対象となる前年第4・四半期がかなりの高水準だったことを踏まえれば、第4・四半期の経済成長率は第3・四半期並みになるのではないかと述べた。

⑤ECB 銀行監督委員会の委員長は、インタビューで、今年の実験テストに不合格、もしくは辛うじて合格となったユーロ圏の銀行は、持続的に利益を上げられることを示す必要があるとの認識を示した。実験テストで明らかになった資本不足を埋めるための単なる資本増強では不十分かもしれないと指摘。持続的に利益を上げることがおそらく主要な課題であり、今後数年における銀行にとっての主なリスクだろうと述べた。その上で、苦境にあえぐ銀行は損失を出している部門の売却が必要になる可能性があるとした。

⑥EU 統計局は、ユーロ圏 18 カ国の 10 月の失業率が前月と変わらずの 11.5% となり、8 月以来横ばいが続いていると発表した。欧州経済は、低成長が続き、雇用の改善も進んでいない。失業率は横ばいだが、失業者数は 2 カ月連続で増加している。ドイツ 4.9% (5.0%)、スペイン 24.0% (24.1%)、フランス 10.5% (10.5%)、イタリア 13.2% (12.9%)、オランダ 6.5% (6.5%)、オーストリア 5.1% (5.1%)、ポーランド 8.3% (8.5%)、ポルトガル 13.4% (13.3%)、スウェーデン 7.9% (7.9%)、ギリシャは 8 月時点で 25.9% だった。EU28 カ国の失業率は前月の改定値と同じ 10.0% だった。

4 : 10

NY 金は、中心限月が 26 日比 22.00 ドル安の 1 オンス = 1175.50 ドルで取引を終了した。

4 : 40

NY 原油は、中心限月が 26 日比 7.54 ドル安の 1 バレル = 66.15 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1175.50	-22.00
NY 原油	66.15	-7.54

(出所: SBILM)

《 NY 金市場 》

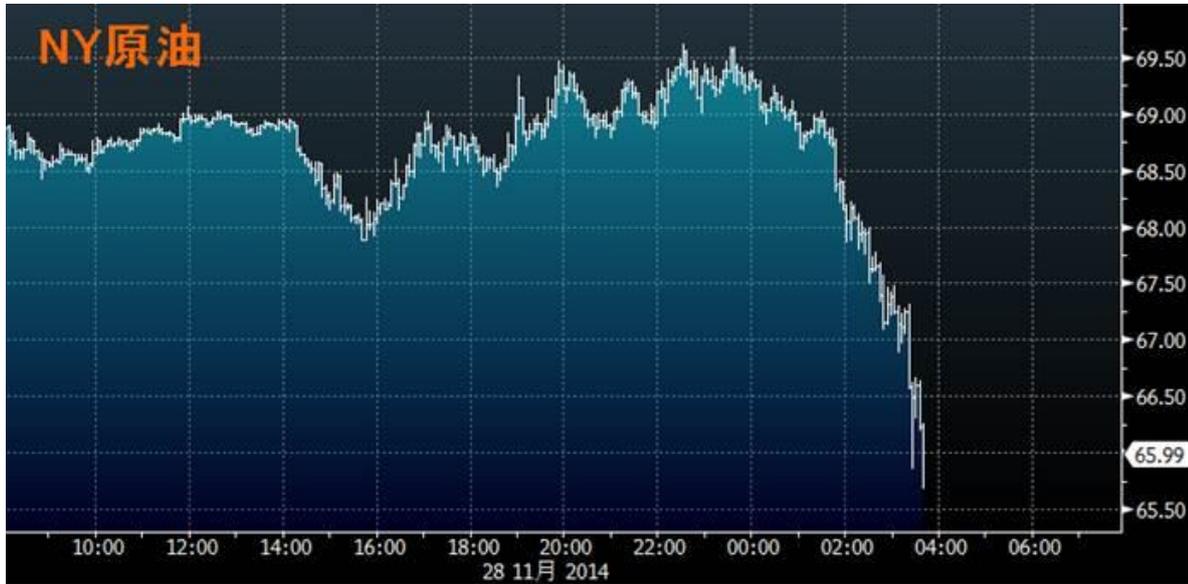
NY 金は、ドルが主要通貨に対して上昇したため、ドルの代替資産とされる金を売る動きが先行した。また、OPEC (石油輸出国機構) の減産見送りを受けた原油価格の急落でインフレ懸念が後退したことで、インフレヘッジとしての金需要も減少した。



(出所: ブルームバーグ)

◀ NY 原油市場 ▶

NY 原油は、OPEC（石油輸出国機構）が減産を見送ったことを受けて需給の緩みへの懸念が一段と強まり、売りが加速した。一時は1バレル=66ドルを割り込む場面もあった。終値ベースでは、2009年9月以来、約5年2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	17828.24	+0.49	17893.42	17807.78
S&P500種	2067.56	-5.27	2075.76	2065.66
ナスダック	4791.63	+4.31	4810.86	4786.72

* 感謝祭明けで短縮取引

(出所:SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、米国の年末商戦は好調との思惑から、ウォルマート・ストアーズなどの小売り関連株を中心に買いが集まった。ただ、OPEC（石油輸出国機構）の減産見送りを受けて石油関連株が売られるなど、序盤はやや上値の重い動きも見られた。その後は利益確定などの動きも見られ、終盤にはマイナス圏まで下落する場面もあった。本日は、感謝祭明けで短縮取引。



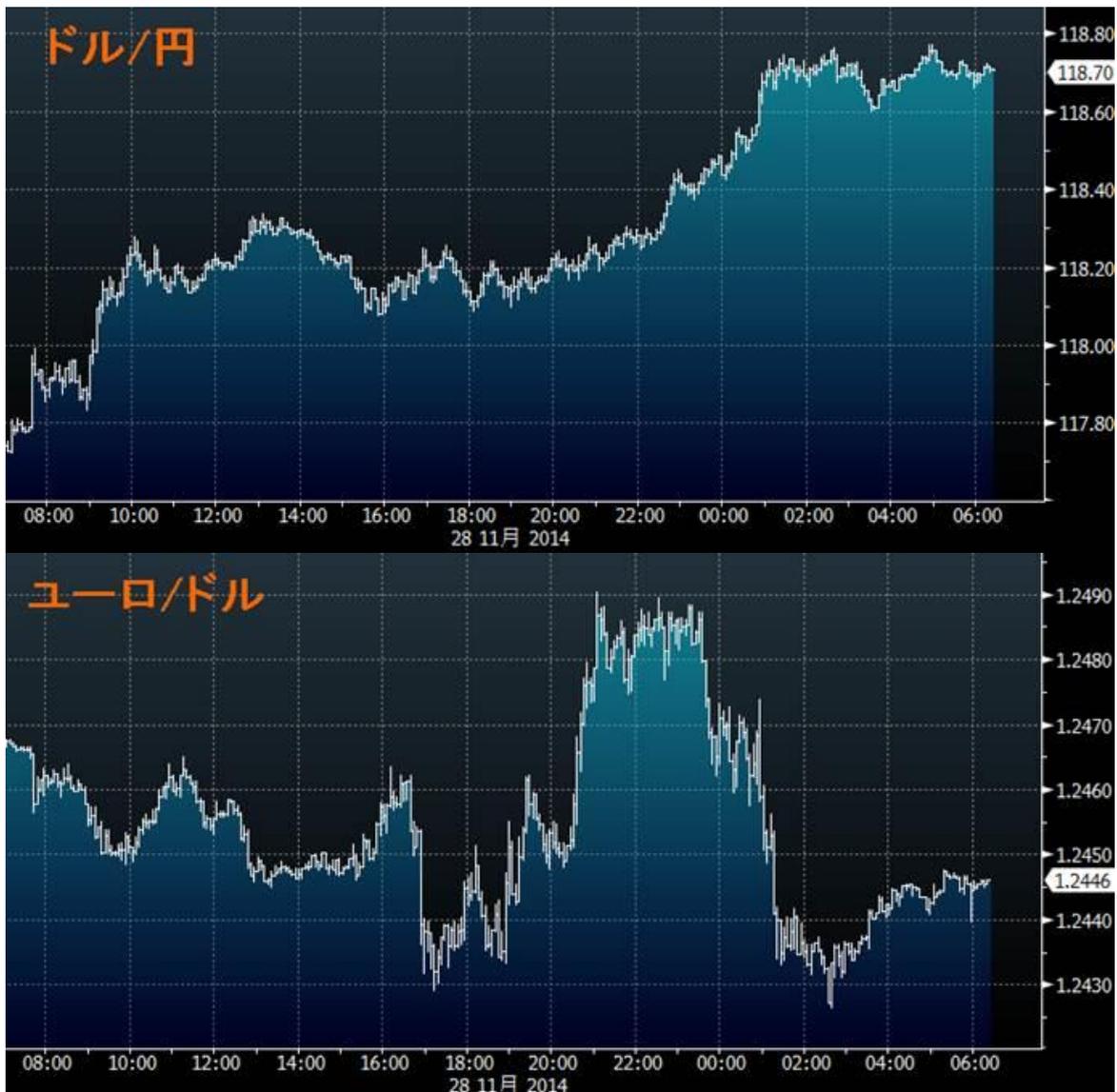
(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	118.69	118.78	118.25
EUR/JPY	147.73	147.97	147.50
GBP/JPY	185.65	185.92	185.24
AUD/JPY	100.96	101.34	100.69
NZD/JPY	93.03	93.29	92.86
EUR/USD	1.2446	1.2490	1.2427
AUD/USD	0.8506	0.8539	0.8499

(出所:SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、前日に OPEC（石油輸出国機構）が生産枠を据え置いたことが引き続き材料視され、原油安が米経済の支援材料になるとの見方から、ドルが主要通貨に対して上昇する動きとなった。一方、豪ドルやノルウェー・クローネ、カナダ・ドル、ロシア・ルーブル、ブラジル・レアルなど、産油国通貨や資源国通貨は引き続き軟調な動きとなった。



(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。