

NY マーケットレポート (2014 年 12 月 2 日)

NY 市場では、ECB 理事会や、米雇用統計を控えて様子見ムードも強まっており、序盤のドル円・クロス円は小動きの展開となった。しかし、フィッシャーFRB 副議長やダドリー・ニューヨーク連銀総裁が、原油価格の下落は米経済にプラスの影響をもたらしていると発言したことなどから、ドルは主要通貨に対して堅調な展開が続いた。一方、ユーロは、ECB 理事会を控えて追加緩和に対する思惑から上値の重い展開が続いた。また、原油価格や商品価格が下落したことを受けて、ノルウェー・クローネや豪ドルなど資源国通貨の下落が目立ち、特にロシアルーブルは、引き続き主要通貨に対して大きく下落する動きとなった。

2014/12/2 (火)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	118.82	118.83	118.23
EUR/JPY	147.97	147.99	147.46
GBP/JPY	186.68	186.72	186.04
AUD/JPY	101.08	101.16	100.27
EUR/USD	1.2455	1.2477	1.2450

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	119.21	118.76
EUR/JPY	148.18	147.74
GBP/JPY	186.94	186.28
AUD/JPY	101.10	100.43
EUR/USD	1.2451	1.2427

*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	17663.22	+73.12
ハンセン指数	23654.30	+286.85
上海総合	2763.54	+83.39
韓国総合指数	1965.83	+0.61
豪ASX200	5281.26	+73.54
インドSENSEX指数	28444.01	-115.61
シンガポールST指数	3322.32	+16.68

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6742.10	+85.73
仏CAC40	4388.30	+10.97
独DAX	9934.08	-29.43
ST欧州600	347.37	+1.73
西IBEX35指数	10749.20	+76.40
伊FTSE MIB指数	19780.58	+94.13
南ア 全株指数	49591.43	+732.67

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	119.25	119.29	119.05
EUR/JPY	147.60	148.19	147.55
GBP/JPY	186.48	186.75	186.29
AUD/JPY	100.71	100.82	100.55
NZD/JPY	93.08	93.40	92.82
EUR/USD	1.2379	1.2434	1.2377
AUD/USD	0.8446	0.8463	0.8433

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17879.55	+102.75
S&P500	2066.55	+13.11
NASDAQ	4755.81	+28.47
その他主要株	終値	前日比
カナダ トロント総合	14620.07	-5.25
ブラジル ボルサ指数	43008.07	-384.00
ロシア ボベスバ指数	51612.47	-664.11

12/3 経済指標スケジュール

09:01 【英】11月BRC店頭価格指数
 09:30 【豪】3Q GDP
 10:00 【中】11月非製造業PMI
 10:45 【中】11月HSBC非製造業PMI
 11:30 【香港】11月購買部景気指数
 15:45 【スイス】3Q GDP
 17:00 【トルコ】11月生産者物価指数
 17:00 【トルコ】11月消費者物価指数
 17:50 ~ 18:30
 【仏】【独】【欧】【英】11月非製造業PMI
 18:30 【南ア】11月SACCI景況感指数
 19:00 【欧】10月小売売上高
 21:00 【米】MBA住宅ローン申請指数
 22:15 【米】11月ADP雇用統計
 22:30 【米】3Q非農業部門労働生産性
 22:15 【ポーランド】政策金利発表(時間不確定)
 00:00 【カナダ】政策金利発表
 00:00 【米】11月ISM非製造業景況指数
 04:00 【米】米地区連銀経済報告[ページブック]

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1199.40	-18.70
NY 原油	66.88	-2.12
CME コーン	381.25	-8.50
CBOT 大豆	995.75	-21.25

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.54%	0.49%
3年債	0.94%	0.89%
5年債	1.59%	1.52%
7年債	2.01%	1.93%
10年債	2.29%	2.21%
30年債	3.01%	2.94%

12/3 主要会議・講演・その他予定

- ・ブレイナードFRB理事 講演
- ・フィラデルフィア連銀総裁 講演
- ・ダラス連銀総裁 講演

(出所: SBILM)

NY 市場レポート

22:00

ドル/円 119.19 ユーロ/円 148.11 ユーロ/ドル 1.2428

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	6739.05	+82.68	ダウ INDEX FUTURE	17812	+57
仏 CAC40	4396.54	+19.21	S&P500 FUTURE	2056.70	+5.90
独 DAX	9967.01	+3.50	NASDAQ FUTURE	4300.50	+14.00

(出所: SBILM)

22:15

《 要人発言 》

フィッシャーFRB 副議長～講演

- ・「原油安は米成長に非常にプラス」
- ・「最近の日本の政策行動は適切」

22:25

《 要人発言 》

ラッカー・リッチモンド連銀総裁～インタビュー

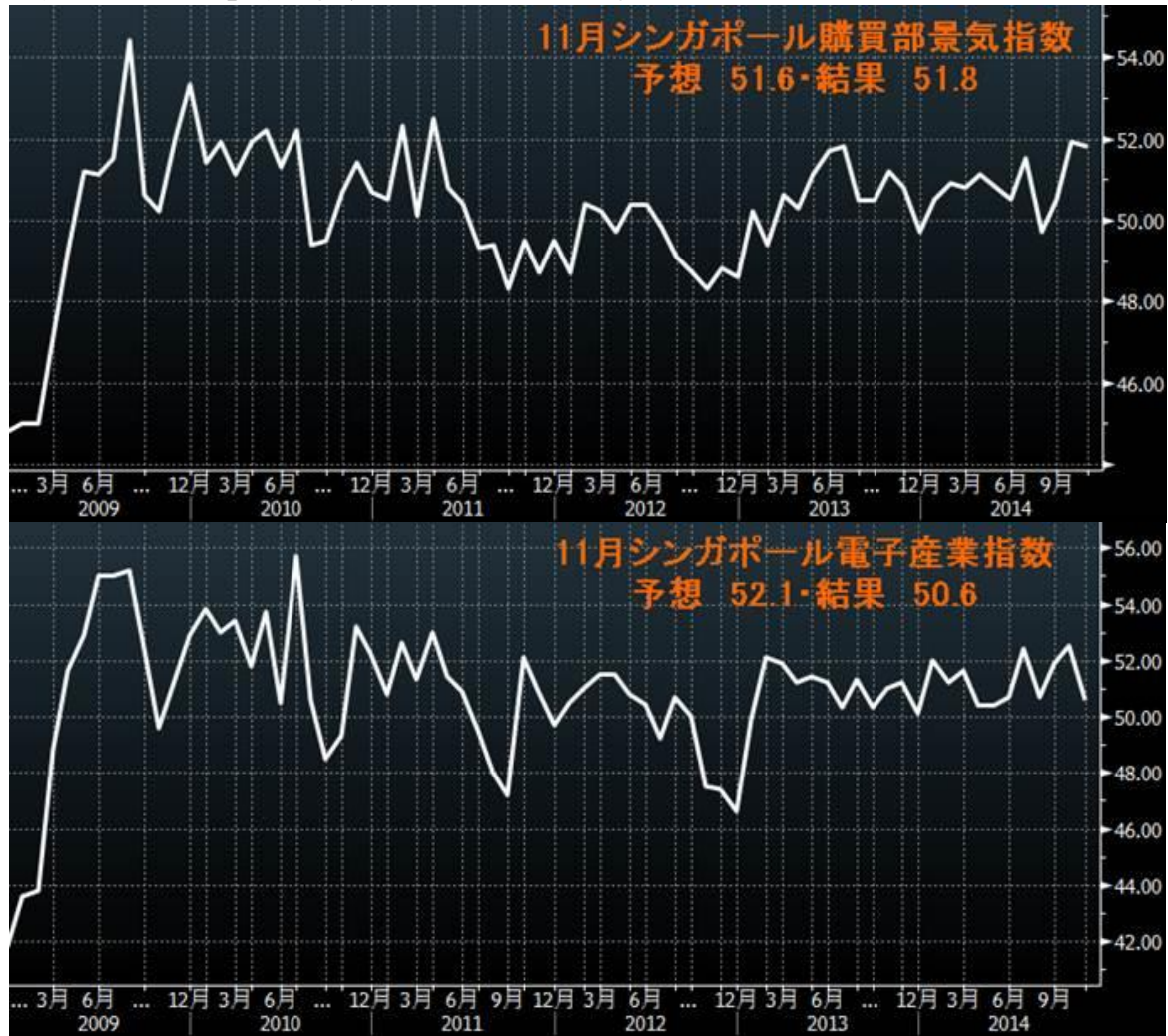
- ・「原油価格の変動は金融安定への懸念ではない」

22 : 30

◀ 経済指標の結果 ▶

11 月シンガポール購買部景気指数 51.8 (予想 51.6・前回 51.9)

11 月シンガポール電子産業指数 50.6 (予想 52.1・前回 52.5)



(出所:ブルームバーグ)

22 : 35

◀ 要人発言 ▶

フィッシャーFRB 副議長～講演

- ・「インフレが低下に向かえば、FRB は金利をゼロ%近辺にとどめる」

23 : 33

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17806.53	+29.73
ナスダック	4734.73	+7.38

(出所:SBILM)

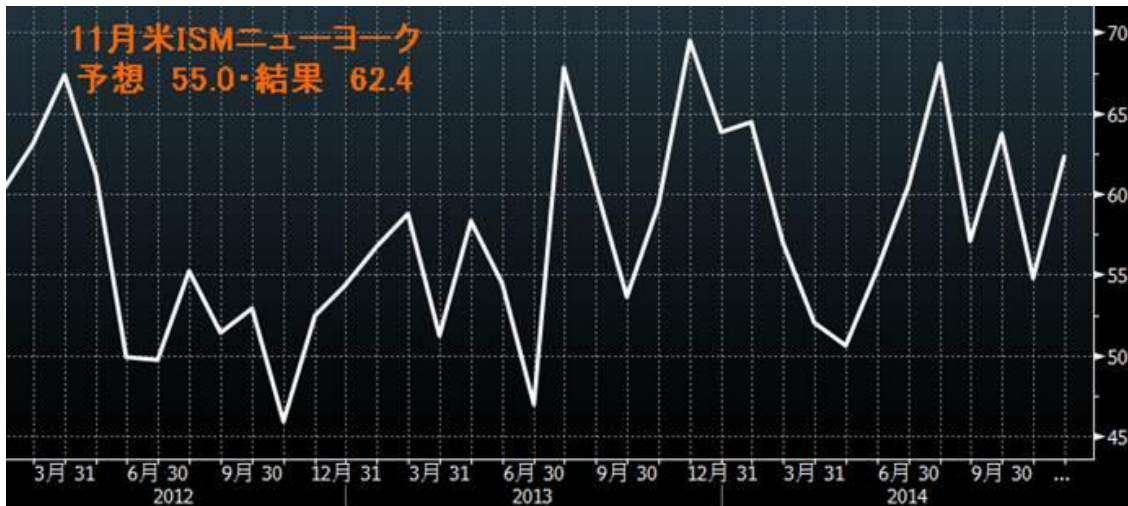
23 : 40

米大統領、国防長官候補にアシュトン・カーター氏指名へ～関係者

23 : 45

≪ 経済指標の結果 ≫

11 月米 ISM ニューヨーク 62.4 (予想 55.0・前回 54.8)



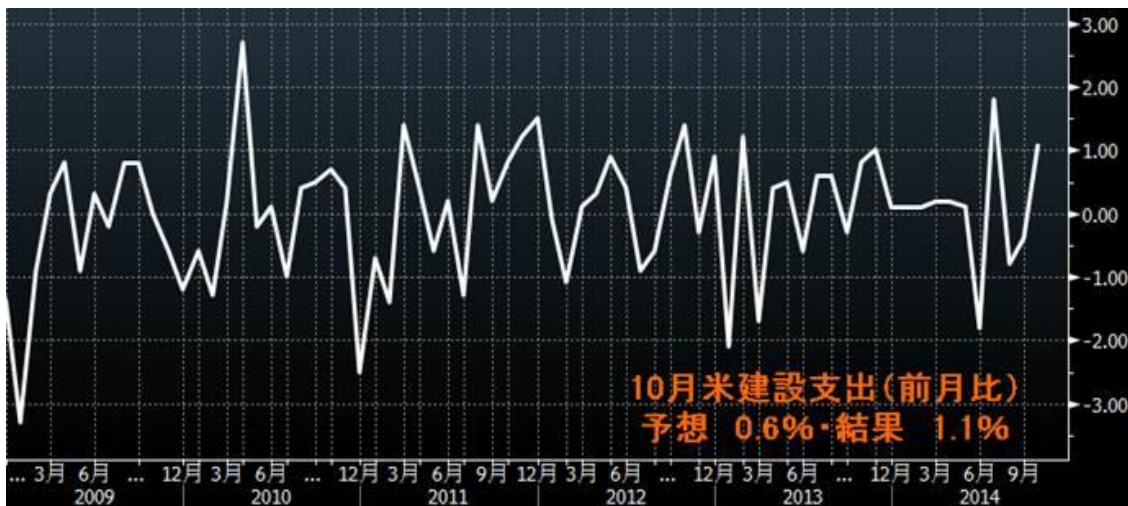
(出所:ブルームバーグ)

0 : 00

≪ 経済指標の結果 ≫

10 月米建設支出 (前月比) 1.1% (予想 0.6%・前回 -0.1%)

前回発表の-0.4%から-0.1%に修正



(出所:ブルームバーグ)

0:30

《 NY 株式市場 序盤 》

序盤の株式市場は、前日の下落で割安感の出た銘柄を買い戻す動きが先行するなど、主要株価は序盤から堅調な動きとなった。また、東京や上海、ロンドンの株式相場が堅調に推移したことも支援材料となった。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 67 ドル高まで上昇する動きとなった。

《 経済指標のポイント 》

10 月の米建設支は、年率換算で前月比+1.1%の 9709 億 8900 万ドルとなり、2 ヶ月ぶりのプラスとなった。金額ベースでは 2014 年 5 月以来、5 ヶ月ぶりの高水準となった。前年同月比は+3.3%となった。民間部門と公共部門がいずれもプラスとなったことが押し上げ要因となった。

①民間の建設支出は、前月比+0.6%の 6923 億 9600 万ドルと 3 ヶ月連続の増加となり、2014 年 5 月以来の高水準となった。住宅建設が+1.3%の 3538 億 200 万ドルと 2 ヶ月連続のプラス。住宅以外の建設は前月比-0.1%、宿泊関連や製造業が伸びた一方、通信や商業などが減少した。

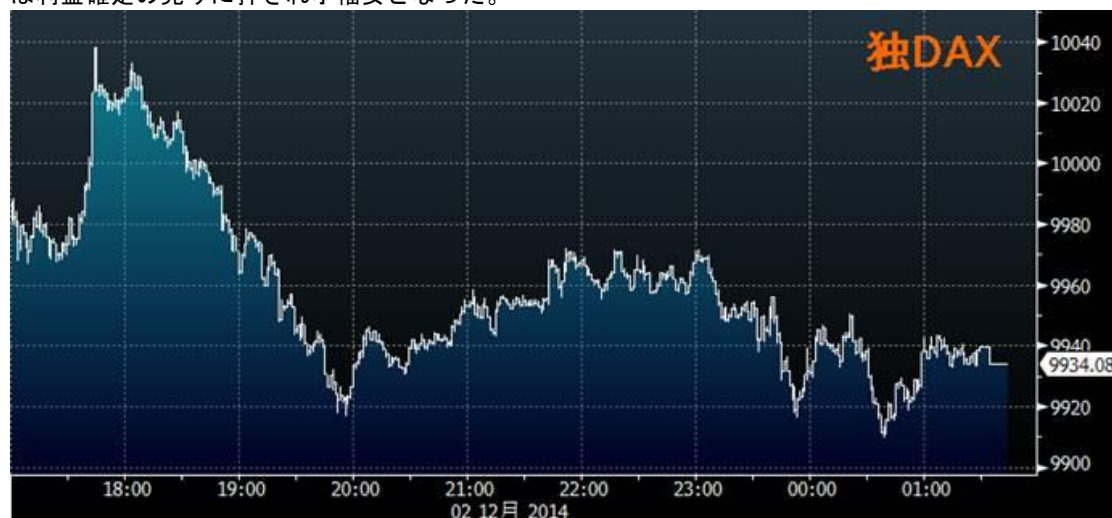
②公共部門の建設支出は、前月比+2.3%の 2785 億 9300 万ドルと 3 ヶ月ぶりの増加。連邦政府が前月比+19.3%、州・地方政府は+0.9%となった。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6742.10	+85.73
仏 CAC40	4388.30	+10.97
独 DAX	9934.08	-29.43
ストック欧州 600 指数	347.37	+1.73
ユーロファースト 300 指数	1392.51	+7.24
スペイン IBEX35 指数	10749.20	+76.40
イタリア FTSE MIB 指数	19780.58	+94.13
南ア アフリカ全株指数	49591.43	+732.67

(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、値頃感が出たことで石油関連株が買い戻されたことで相場を押し上げた。一方、独 DAX は、ECB の追加緩和への期待を背景に、一時 10000 ポイント台に上昇したが、その後は利益確定の売りに押され小幅安となった。



(出所: ブルームバーグ)

2 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 17841.05 (+64.25)、 S&P500 2063.13 (+9.69)、 ナスダック 4751.93 (+24.58)

≪ NY 債券市場 ・ 午前 ≫

序盤のニューヨーク債券市場は、米国株の上昇で投資家のリスク志向が強まり、安全資産とされる米国債を売る動きが先行した。インターネット小売り大手アマゾン・コムなど、企業による大量の社債発行に伴うヘッジ売りの動きも広がり、相場を圧迫した。

午前の利回りは、30 年債が 3.00% (前日 2.96%)、10 年債が 2.28% (2.24%)、7 年債が 1.99% (1.95%)、5 年債が 1.58% (1.54%)、3 年債が 0.94% (0.90%)、2 年債が 0.53% (0.50%)。

≪ 欧州のポイント ≫

①ノルウェー財務省は、世界最大の政府系ファンドであるノルウェー政府年金基金グローバルについて、インフラ投資や不動産へのさらなる分散投資を認める可能性があると表明した。声明によると、政府は同基金の戦略委員会や資金運用を担う中銀に対し、改革の可能性について検討するよう要請した。最終評価は 2016 年春までに議会で公表されることになる。ノルウェー政府年金基金は、ノルウェーの石油・ガス収入を運用し、資産総額は 8700 億ドルに相当する。世界の株式の 1%以上を保有している。

②EU 統計局が発表した 10 月のユーロ圏生産者物価指数は、前月比-0.4%となり、市場予想の-0.3%を下回り、1 年ぶりの大幅な低下となった。低下だった。石油などコモディティ価格の下落を受けたエネルギーと非耐久消費財の低下が響いた。前年比では-1.3%となった。

③ECB (欧州中央銀行) は、期間 7 日の流動性供給オペを実施し、153 行に 980 億 4600 万ユーロを供給したことを明らかにした。

11 月の米自動車販売

- ・クライスラーは+20.1% (予想+15.9%)
- ・GMは+6.5% (予想+2.6%)
- ・フォードは-1.8% (予想-2.0%)
- ・トヨタは+3.0% (予想+2.1%)
- ・日産は-3.1% (予想は-5.0%)
- ・ホンダは+4.6% (予想+4.3%)

5 : 00

NY 金は、中心限月が前日比 18.70 ドル安の 1 オンス=1199.40 ドルで取引を終了した。

5 : 40

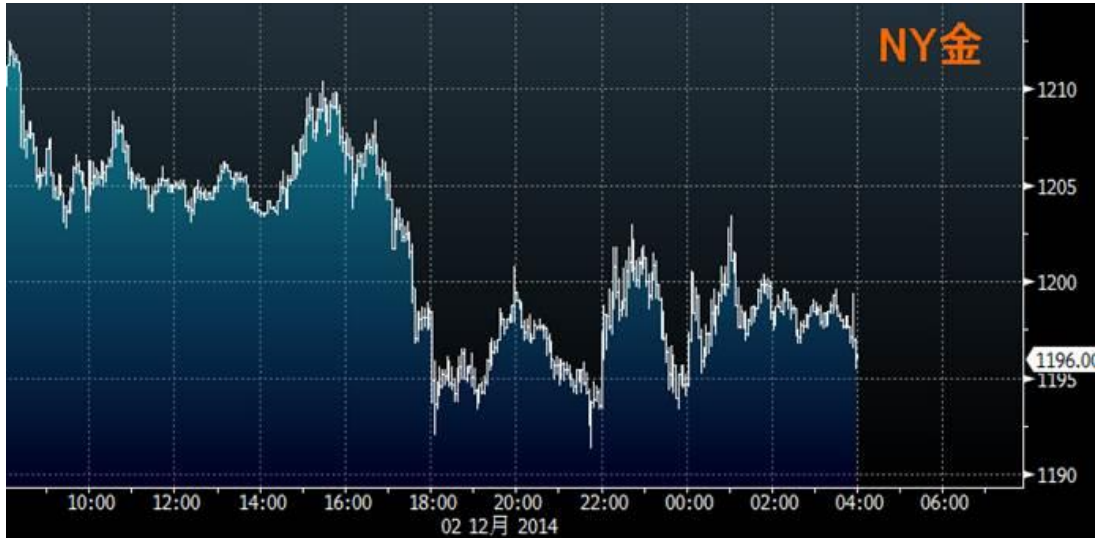
NY 原油は、中心限月が前日比 2.12 ドル安の 1 バレル=66.88 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1199.40	-18.70
NY 原油	66.88	-2.12

(出所: SBILM)

《 NY 金市場 》

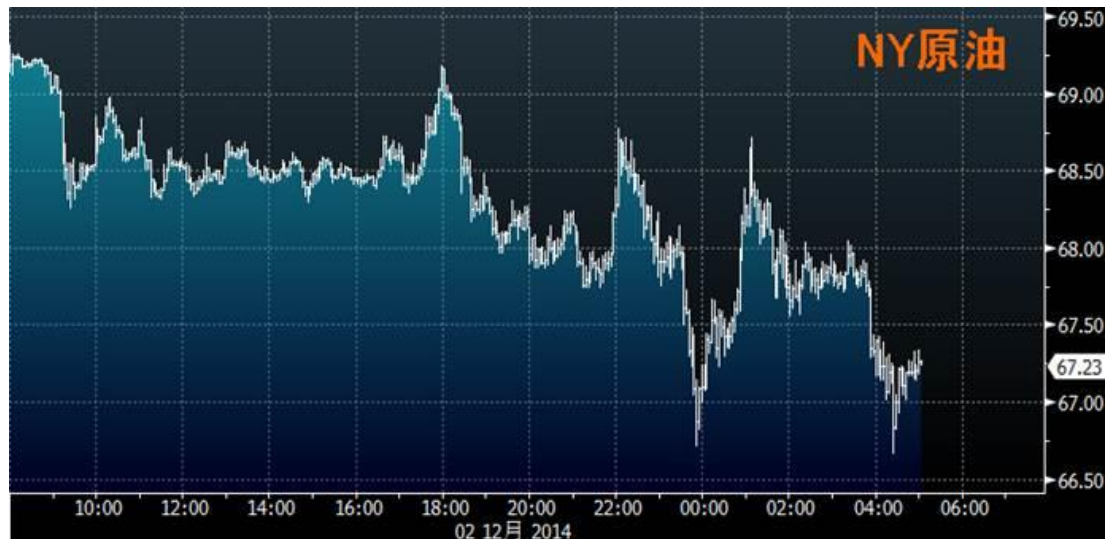
NY金は、ドルが主要通貨に対して上昇したため、ドルの代替資産とされる金の売りが優勢となった。また、原油相場下落を受けて、インフレヘッジのための金の需要が後退したことも圧迫要因となった。



(出所:ブルームバーグ)

《 NY 原油市場 》

NY原油は、イラク中央政府とクルド自治政府が、自治区外にある油田からの石油輸出などで合意したとの報道を受けて、供給が一段と増えるとの警戒感から売り優勢となった。また、ドルがユーロや円などに対して上昇したことで、ドル建て原油の割高感も圧迫材料となった。



(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	17879.55	+102.75	17897.05	17778.85
S&P500 種	2066.55	+13.11	2068.77	2053.77
ナスダック	4755.81	+28.47	4761.63	4729.76

(出所: SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、前日の下落で割安感の出た銘柄を買い戻す動きが先行するなど、主要株価は序盤から堅調な動きとなった。また、東京や上海、ロンドンの株式相場が堅調に推移したことも支援材料となった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きが続き、終盤には一時前日比で 120 ドル高まで上昇し、取引時間中の最高値を更新した。また、終値ベースで最高値を更新する動きとなった。



(出所: ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	119.25	119.29	119.05
EUR/JPY	147.60	148.19	147.55
GBP/JPY	186.48	186.75	186.29
AUD/JPY	100.71	100.82	100.55
NZD/JPY	93.08	93.40	92.82
EUR/USD	1.2379	1.2434	1.2377
AUD/USD	0.8446	0.8463	0.8433

(出所: SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、ECB 理事会や米雇用統計を控えて様子見ムードも強まっており、主要通貨はやや限定的な動きとなった。ただ、ユーロは、追加緩和へ可能性を背景に、主要通貨に対してやや軟調な動きが続いた。



(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。