

NY マーケットレポート (2015年12月23日)

NY 市場では、序盤に耐久財受注、新築住宅販売件数、ミシガン大学消費者信頼感指数などの米国の主要な経済指標が発表されたものの、クリスマス休暇を前にして、市場参加者も少なく、反応は限定的となった。その後は、堅調な株価動向を受けて、円が売られる動きとなったものの、全般的に方向感に乏しい動きとなった。ユーロは、週明けから堅調な動きが続いた反動から、大半の主要通貨に対して軟調な動きが続いた。ただ、ユーロ売りが一巡すると、やや値を戻す動きとなった。

2015/12/23 (水)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	120.97	121.14	120.91
EUR/JPY	132.28	132.65	132.19
GBP/JPY	179.70	179.79	179.33
AUD/JPY	87.61	87.66	87.46
EUR/USD	1.0935	1.0958	1.0929

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	121.06	120.86
EUR/JPY	132.28	132.03
GBP/JPY	180.16	179.49
AUD/JPY	87.62	87.29
EUR/USD	1.0936	1.0914

*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	休 場	
ハンセン指数	22040.59	+210.57
上海総合	3636.09	-15.68
韓国総合指数	1999.22	+6.66
豪ASX200	5141.78	+25.09
インドSENSEX指数	25850.30	+259.65
シンガポールST指数	2863.65	+10.68

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6240.98	+157.88
仏CAC40	4674.53	+106.93
独DAX	10727.64	+238.89
ST欧州600	366.39	+9.52
西IBEX35指数	9641.00	+225.40
伊FTSE MIB指数	21456.36	+396.23
南ア 全株指数	50839.81	+1059.48

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	120.88	121.02	120.82
EUR/JPY	131.91	132.06	131.50
GBP/JPY	179.70	180.17	179.54
AUD/JPY	87.51	87.55	87.15
NZD/JPY	82.13	82.20	81.78
EUR/USD	1.0915	1.0925	1.0870
AUD/USD	0.7240	0.7246	0.7209

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17602.61	+185.34
S&P500	2064.29	+25.32
NASDAQ	5045.93	+44.82
日経225 (CME)	19060	+150
🇨🇦 トロント総合	13284.91	+202.05
🇧🇷 ボルサ指数	43579.67	+250.95
🇧🇷 ボベスバ指数	44014.93	+545.42

12/24 経済指標スケジュール

08:00 【豪】10月コンファレンスボード景気先行指数
 08:50 【日】11月日銀金融政策決定会合・議事要旨公表
 14:00 【シンガポール】11月鉱工業生産
 16:00 【独】11月輸入物価指数
 18:30 【英】11月BBA住宅ローン承認件数
 20:00 【仏】11月求職者合計
 22:30 【米】新規失業保険申請件数
 22:30 【米】失業保険継続受給者数
 23:00 【メキシコ】11月貿易収支
 23:00 【メキシコ】11月失業率

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1068.30	-5.80
NY 原油	37.50	+1.36
CMEコーン	365.50	-0.75
CBOT 大豆	37.50	+1.36

米国債利回り	本 日	前 日
2年債	0.99%	0.97%
3年債	1.31%	1.30%
5年債	1.72%	1.69%
7年債	2.06%	2.04%
10年債	2.26%	2.23%
30年債	2.99%	2.95%

12/24 主要会議・講演・その他予定

- ・独市場休場
- ・黒田日銀総裁 講演

(出所:SBILM)

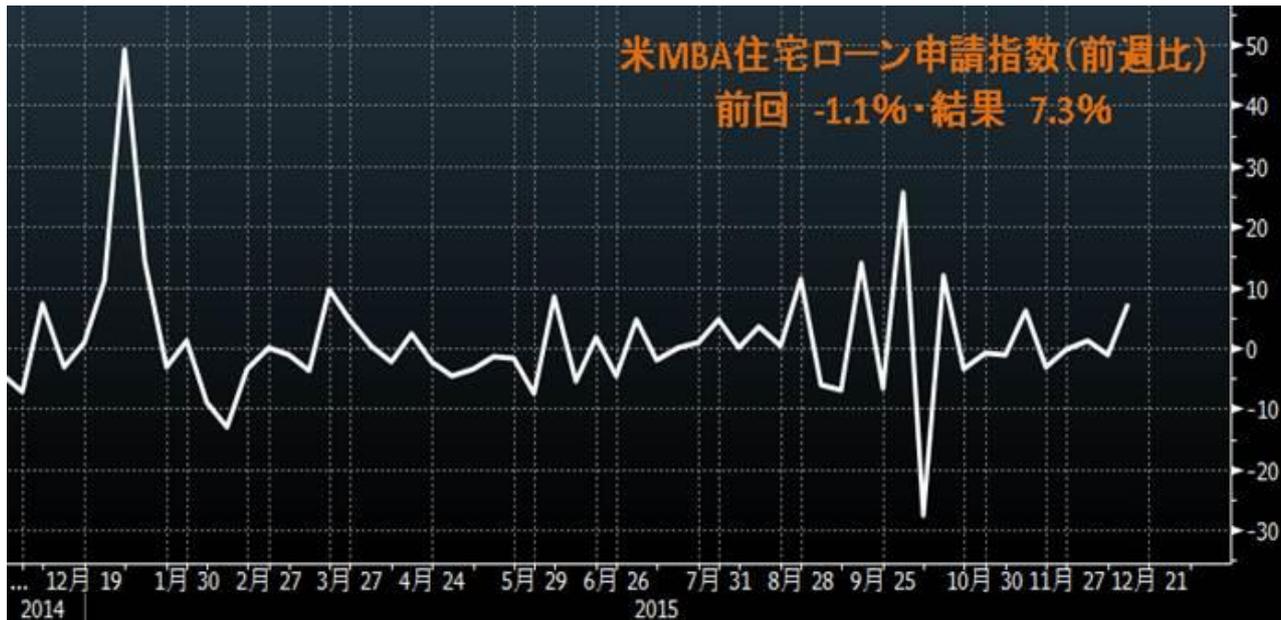
NY 市場レポート

欧州タイム

21 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

米 MBA 住宅ローン申請指数 (前週比) 7.3% (前回 -1.1%)



(出所：ブルームバーグ)

指標結果データ

◀MBA 住宅ローン申請指数▶

	12/18	12/11	12/4	11/27	11/20	11/13	前年同期
申請指数	7.3	-1.1	1.2	-0.2	-3.2	6.2	23.9
購入	4.1	-2.8	0.0	7.7	-0.5	11.9	37.6
借換え	10.8	1.4	3.5	-6.0	-4.8	2.3	14.9
固定金利	7.2	-0.9	1.2	0.0	-3.3	6.5	24.4
変動金利	9.0	-4.3	2.5	-3.7	-1.8	1.0	17.2

(%)

ローン契約平均金利 (%)

固定金利 30年 4.16 4.14 4.14 4.12 4.14 4.18

固定金利 15年 3.45 3.38 3.39 3.36 3.39 3.40

21 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

11月南ア財政収支 -217.9億 ZAR (予想 -220.0億 ZAR・前回 -265.5億 ZAR)



(出所：ブルームバーグ)

22:00

ドル/円 120.91 ユーロ/円 132.06 ユーロ/ドル 1.0922

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	6213.58	+130.48	ダウ 先物ミニ	17449	+92
仏 CAC40	4656.32	+88.72	S&P 500 ミニ	2043.75	+7.75
独 DAX	10482.78	+194.03	NASDAQ 100 ミニ	4608.00	+17.00

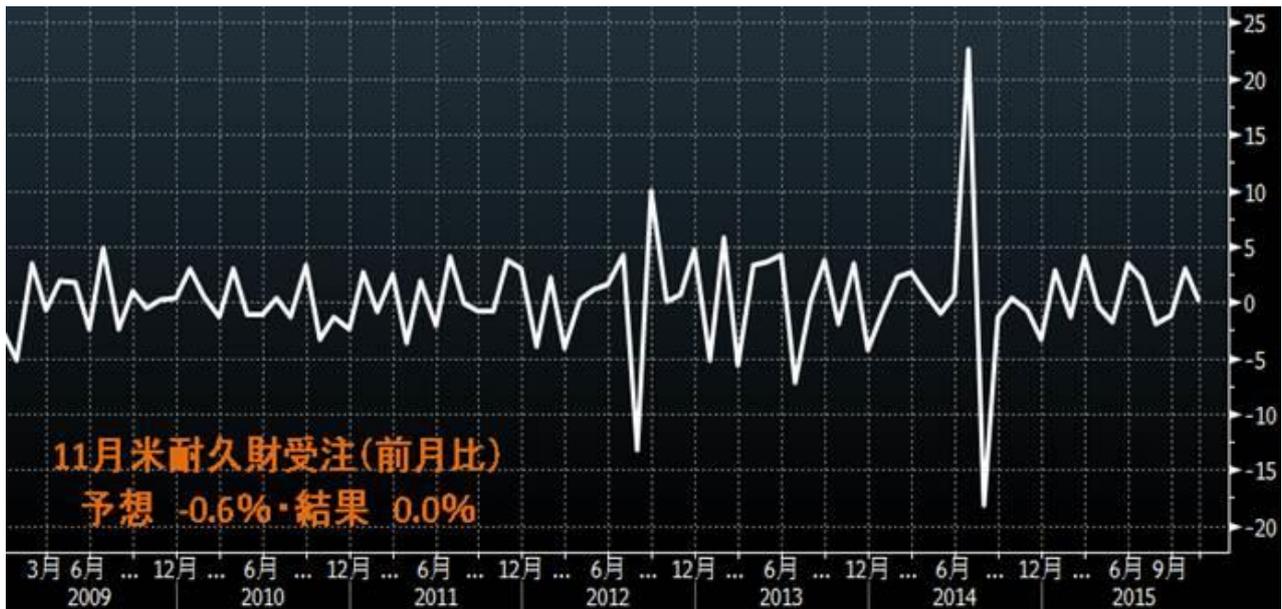
(出所：SBILM)

22:30

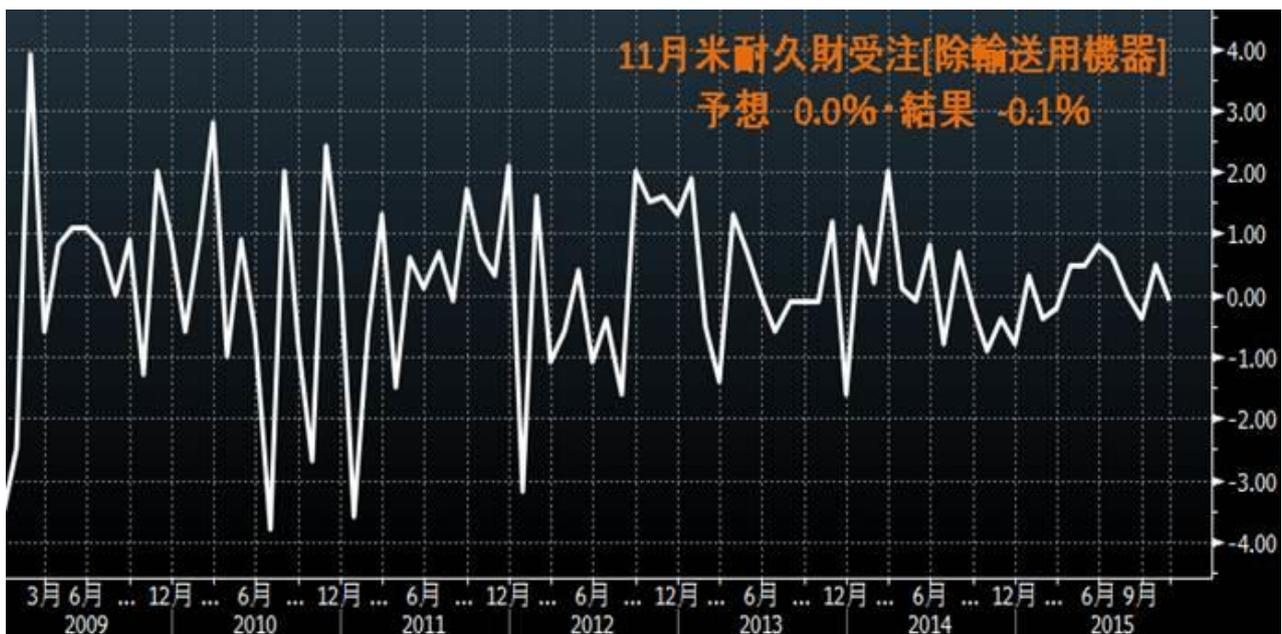
◀ 経済指標の結果 ▶

11月米耐久財受注(前月比) 0.0% (予想 -0.6%・前回 2.9%)

11月米耐久財受注[除輸送用機器] -0.1% (予想 0.0%・前回 0.5%)



(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

《米耐久財受注》

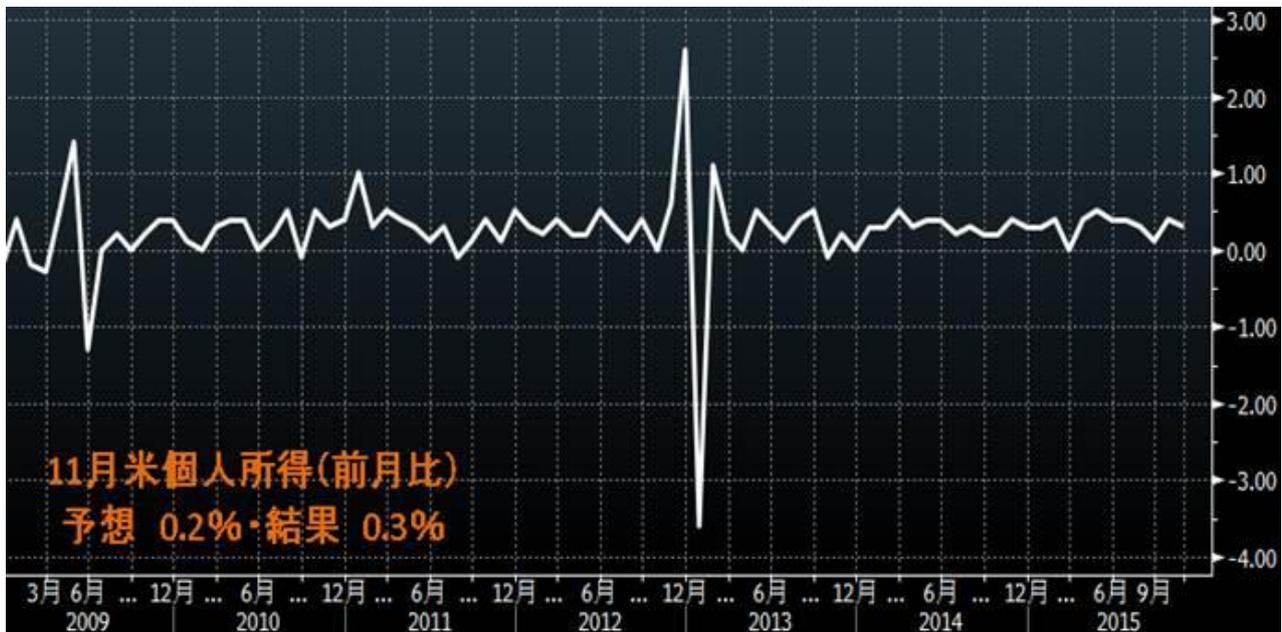
	11月	10月	9月	8月	7月	6月
耐久財新規受注	0.0	2.9	-0.8	-2.9	1.9	4.1
輸送機器除く	-0.1	0.5	-0.1	-0.9	0.4	1.0
国防関連除く	-1.5	3.0	-1.6	-2.1	0.8	4.2
資本財	-1.0	11.0	-4.3	-7.0	3.0	9.9
輸送機器	0.4	7.8	-2.2	-6.9	4.9	10.8
総受注残	0.2	0.3	-0.5	-0.3	0.2	0.0
総在庫	-0.3	-0.3	-0.6	-0.2	0.0	0.4
総出荷	0.9	-1.2	0.3	-0.5	1.0	0.9

22 : 30

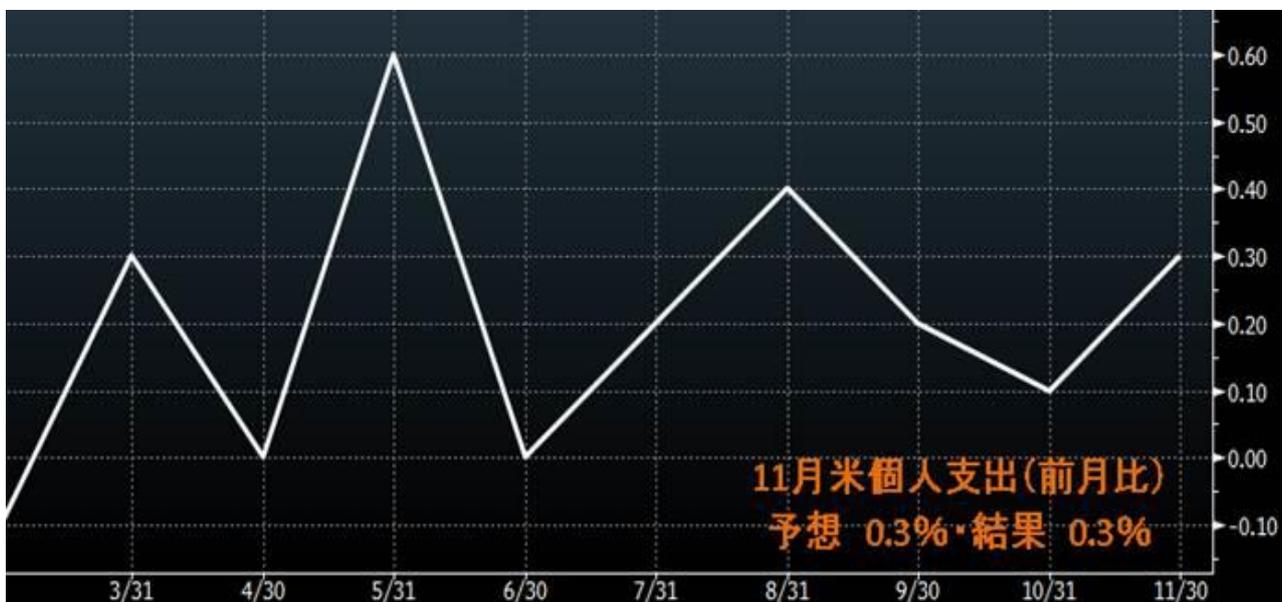
◀ 経済指標の結果 ▶

11月米個人所得（前月比） 0.3%（予想 0.2%・前回 0.4%）

11月米個人支出（前月比） 0.3%（予想 0.3%・前回 0.1%）



(出所：ブルームバーグ)



(出所：ブルームバーグ)

指標結果データ

◀ 米個人所得・支出 ▶

	11月	10月	9月	8月	7月	6月
個人所得	0.3	0.4	0.2	0.4	0.4	0.5
賃金・給与	0.5	0.6	0.0	0.4	0.5	0.4
可処分所得	0.3	0.4	0.2	0.4	0.5	0.5
個人消費支出	0.3	0.0	0.2	0.3	0.3	0.3
個人貯蓄率	5.5	5.6	5.2	5.2	5.1	5.0

22:30

◀ 経済指標の結果 ▶

11月米 PCE デフレーター（前年比） 0.4%（予想 0.4%・前回 0.2%）

11月米 PCE コア・デフレーター（前月比） 0.1%（予想 0.1%・前回 0.0%）

11月米 PCE コア・デフレーター（前年比） 1.3%（予想 1.3%・前回 1.3%）



(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	17545.58	+128.31
ナスダック	5026.29	+25.18

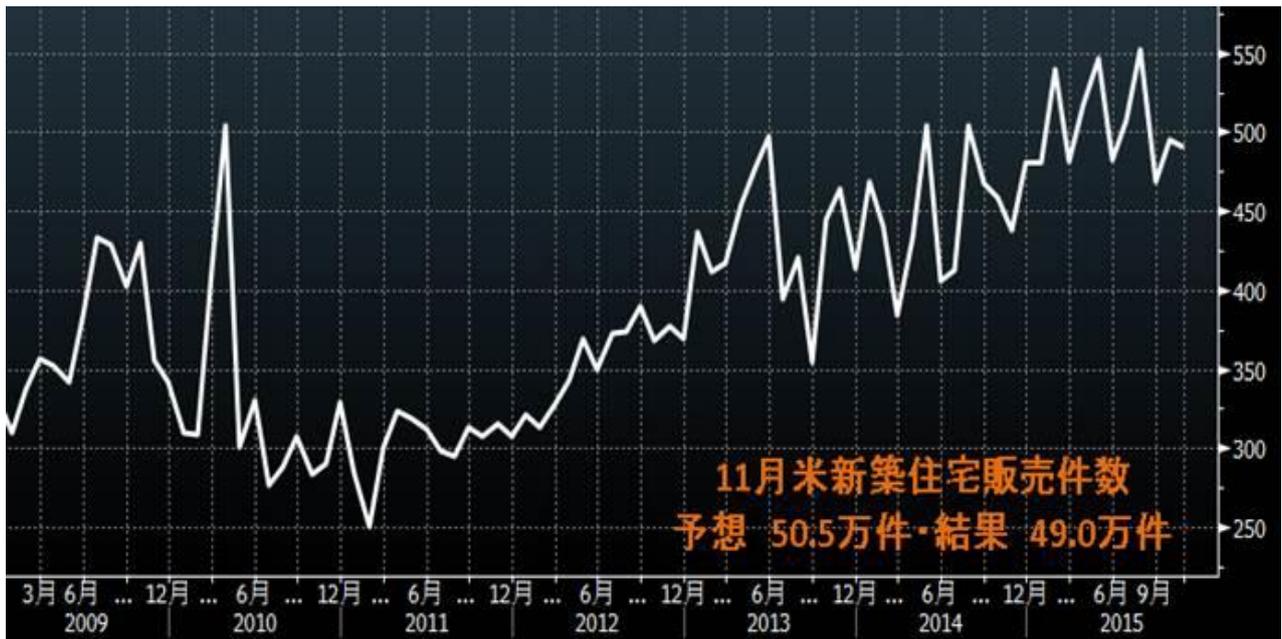
(出所：SBILM)

0 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

11月米新築住宅販売件数 49.0万件 (予想 50.5万件・前回 47.0万件)
前回発表の49.5万件から47.0万件に修正

11月米新築住宅販売件数(前月比) 4.3% (予想 2.0%・前回 6.3%)
前回発表の10.7%から6.3%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》

	11月	10月	9月	8月	7月	6月
販売戸数	49.0	47.0	44.2	50.7	50.0	46.9
前月比 (%)	4.3	6.3	-12.8	1.4	6.6	-8.6
	(万件)					
	11月	10月	9月	8月	7月	6月
北東部	2.5	3.5	1.9	3.1	2.8	2.6
中西部	5.3	5.8	5.7	5.8	6.2	5.9
南部	27.7	26.5	25.8	29.7	28.6	26.4
西部	13.5	11.2	10.8	12.2	12.4	12.0
	(万件)					

0 : 00

《 経済指標の結果 》

12月ミシガン大学消費者信頼感指数 92.6% (予想 92.0・前回 91.8)



経済指標データ

《ミシガン大学消費者信頼感指数》

12月確報・12月速報・11月・10月・9月・8月・7月

消費者信頼感	92.6	91.8	91.3	90.0	87.2	91.9	93.1
景気現況指数	108.1	107.0	104.3	102.3	101.2	105.1	107.2
消費者期待指数	82.7	82.0	82.9	82.1	78.2	83.4	84.1
1年インフレ	2.6	2.6	2.7	2.7	2.8	2.8	2.8
5年インフレ	2.6	2.6	2.6	2.5	2.7	2.7	2.8

0:30

《EIA 米週間在庫統計》

原油在庫	588万バレル減少
ガソリン在庫	111万バレル増加
留出油在庫	66.1万バレル減少

0:40

《 NY 株式市場 序盤 》

序盤の株式市場は、7-9月期の米GDP確定値が市場予想を上回り、堅調な米景気回復が続いていると受け止められたことを受けて、主要株価は堅調な動きとなっている。また、原油価格が上昇したことでエネルギー関連株が上昇したことも押し上げ要因となった。

《 経済指標のポイント 》

(1) MBA(全米抵当貸付銀行協会)が発表したMBA住宅ローン申請指数は、7.3%となり、前週の-1.1%から大きく改善した。構成指数の購入指数は+4.1%(前週-2.8%)、借り換え指数は+10.8%(+1.4%)となり、借り換え指数の改善が全体を押し上げる結果となった。30年固定金利型の住宅ローン金利は4.16%(4.14%)、15年固定金利型の住宅ローン金利は、3.45%(3.38%)となった。申請全体に占める借り換えの割合は62.8%(60.7%)

(2) 11月の米耐久財受注は前月比横ばいの2387億7600万ドルとなり、市場予想の-0.6%を上回る結果となった。国防航空機と自動車の伸びが全体を押し上げる結果となった。

①受注の内訳は、輸送機器が+0.4%となり、変動の激しい国防関連の航空機が46.9%、民間航空機は-22.2%、自動車・同部品は+1.5%だった。輸送機器を除いた受注は-0.1%と市場予想の横ばいを下回った。

②輸送機器以外では、電機・家電が+2.6%で、昨年12月以来の高水準、電算機・電子機器が+0.4%、一次金属は-2.7%、一般機械は-1.5%。

③資本財は-1.0%となり、資本財から国防関連を除いた受注は-6.3%。民間設備投資の先行指標となる非国防資本財から航空機を除いたコア受注は-0.4%。国防関連は+44.74%となった。

④耐久財全体の出荷高は+0.9%、受注残高も+0.2%。一方、在庫高は-0.3%だった。

(3) 11月の米個人所得・消費統計では、個人消費支出が前月比+0.3%と市場予想と一致し、8月以来3ヵ月ぶりの大きな伸び率となった。個人所得は+0.3%と、市場予想の+0.2%を上回った。消費の内訳は、自動車や家具などの耐久財が+0.7%、食品やエネルギーなどの非耐久財も+0.5%、サービスは+0.2%。

(4) 11月の米新築住宅販売件数は、年率換算で前月比+4.3%の49万件となり、2ヵ月連続のプラスとなった。ただ、市場予想の50.5万件を下回ったことや、大台の50万件割れとなった。前年同月比では+9.1%。

①市場の住宅在庫は、前月比+2.2%の23.2万件と件数ベースで2010年1月以来の高水準となり、販売に対する在庫率は5.7ヵ月と前月から0.1ヵ月低下し、適正水準とされる6.0ヵ月を下回った。

②販売物件の中間価格は、前月比+6.3%の30.5万ドル、平均価格は+4.7%の37.5万ドルと昨年10月以来の高水準となった。

③地域別では、最大市場の南部は+4.5%、西部は+20.5%、北東部が-28.6%、中西部が-8.6%だった。

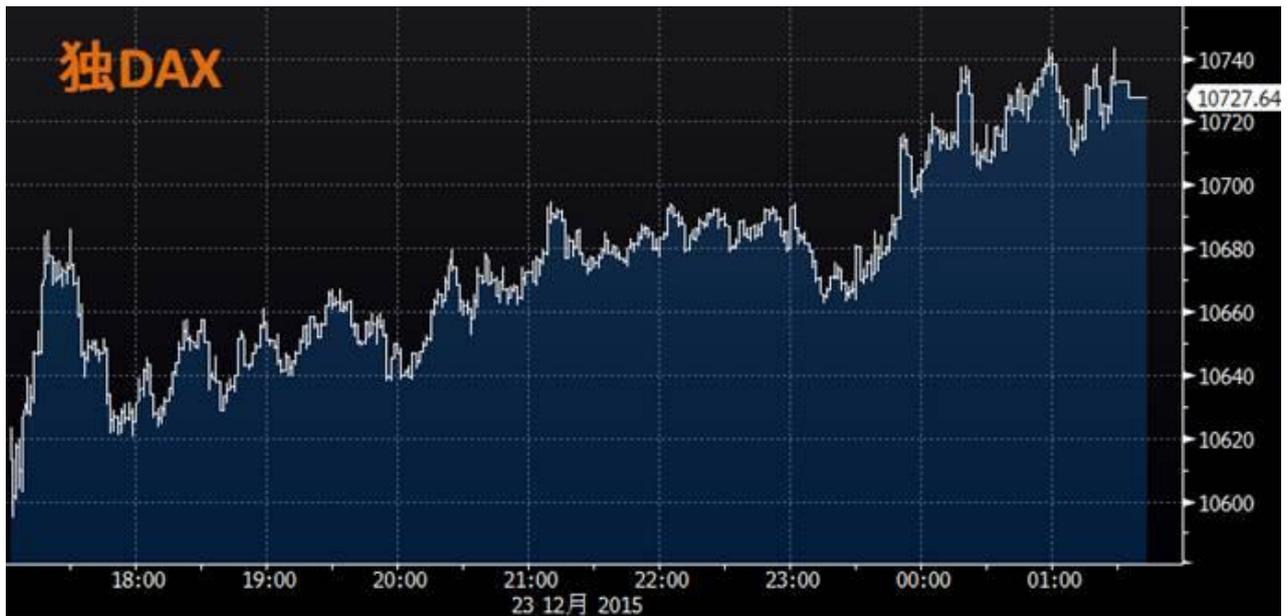
(5) 12月の米ミシガン大学消費者信頼感指数の確報値は92.6となり、12月の速報値から0.8ポイント上昇、前月から1.3ポイント上昇し、5ヵ月ぶりの高水準となった。また、市場予想の92.0も上回った。現状指数は108.1と12月速報値から1.1ポイント上昇、前月比では3.8ポイント改善した。1年後のインフレ期待は2.6%で12月速報値から横ばい、前月から0.1ポイント低下した。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6240.98	+157.88
仏 CAC40	4674.53	+106.93
独 DAX	10727.64	+238.89
ストック欧州 600 指数	366.39	+9.52
ユーロファースト 300 指数	1440.87	+39.43
スペイン IBEX35 指数	9641.00	+225.40
イタリア FTSE MIB 指数	21456.36	+396.23
南ア アフリカ全株指数	50839.81	+1059.48

(出所: SBILM)

＜欧州株式市場＞

欧州株式市場は、原油相場の上昇や、中国の景気刺激策への期待などが投資家心理を支え、主要株価は軒並み大幅上昇となった。



(出所：ブルームバーグ)

2 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 17567.26 (+149.99)、S&P500 2057.36 (+18.39) ナスダック 5036.88 (+35.76)

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、原油先物相場の続伸でインフレ懸念が高まり、米国債の売りが先行した。原油値上がりに伴って投資家のリスク志向が強まり、安全資産としての需要も後退した。米個人消費支出と個人所得が堅調に増えたことも圧迫要因となった。

午前の利回りは、30年債が3.01%（前日2.96%）、10年債が2.28%（2.24%）、7年債が2.08%（2.05%）、5年債が1.73%（1.71%）、3年債が1.32%（1.31%）、2年債が0.99%（0.98%）。

《ポイント》

OPEC（石油輸出国機構）は、世界石油見通しで、OPECの原油供給量が2040年には日量4070万バレルと2014年から3割以上の大幅増となる見通しを示した。非加盟国の供給量（3950万バレル）を上回るとしている。OPECの原油供給量は、2014年は3000万バレルで、ロシアなどの非加盟国の4270万バレルを下回っている。一部の加盟国がさらなるシェアの低下を警戒し、今月初めの総会では減産の見送りを決めるなど、価格調整での役割低下が指摘されている。

4 : 20

NY金は、中心限月が前日比5.80ドル安の1オンス=1068.30ドルで取引を終了した。

5 : 10

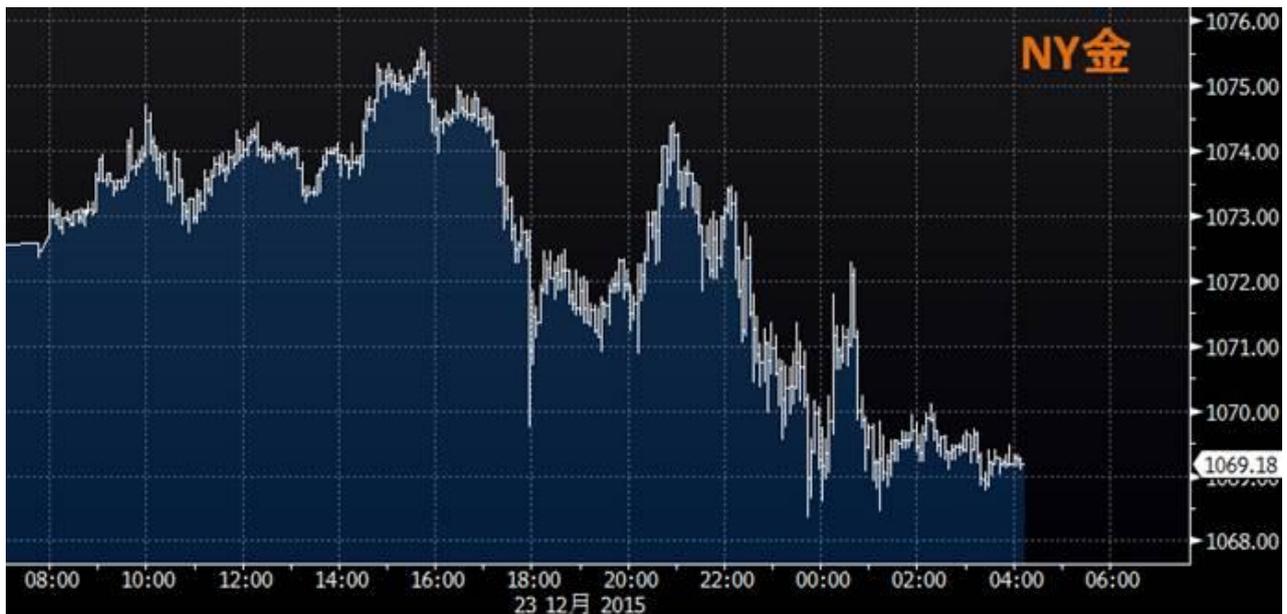
NY原油は、中心限月が前日比1.36ドル高の1バレル=37.50ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1068.30	-5.80
NY 原油	37.50	+1.36

(出所: SBILM)

◀ NY 金市場 ▶

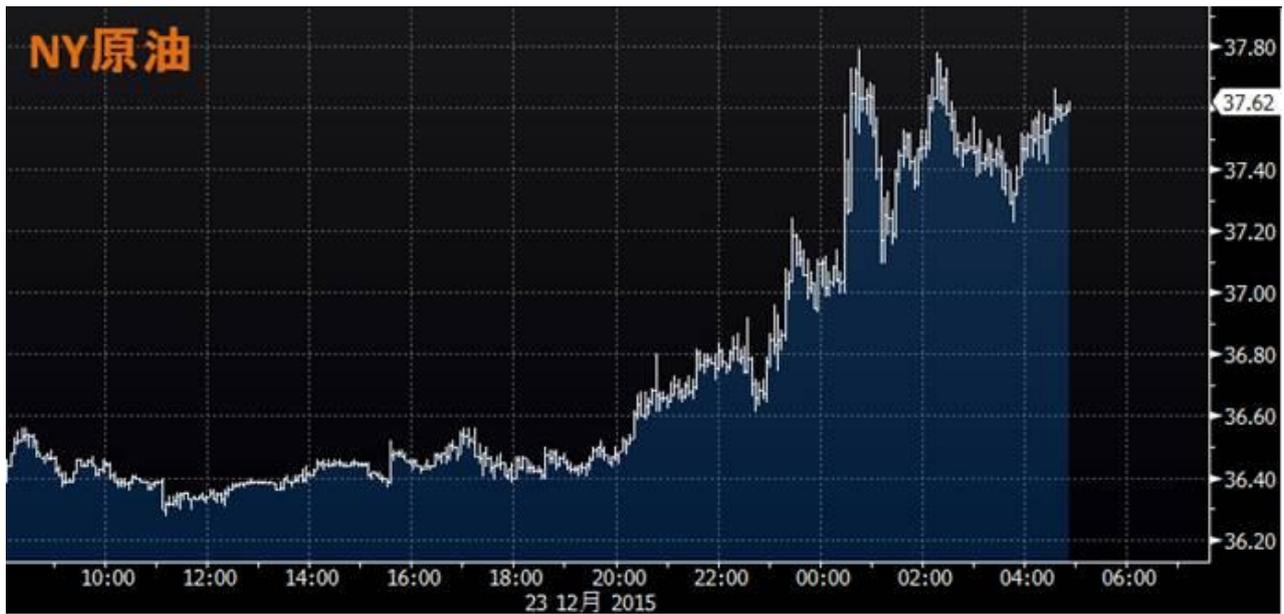
NY金は、ドルがユーロなどに対して上昇したため、ドルの代替資産とされる金を売る動きが先行した。欧米の株価が大幅上昇となったことから、比較的安全な資産としての需要も弱まった。



(出所: ブルームバーグ)

◀ NY 原油市場 ▶

NY原油は、米石油統計で原油在庫が市場予想に反して大幅に減少したことから、供給過剰感が後退し、買いが優勢となった。また、最近の下落で値頃感が出たことによる買い戻しが入ったことも、相場を押し上げる要因となった。



(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	17602.61	+185.34	17607.92	17427.63
S&P500 種	2064.29	25.32	2064.73	2042.20
ナスダック	5045.93	+44.82	5046.09	5020.44

(出所：SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、前日の 7-9 月期の米 GDP 確定値が市場予想を上回り、米景気回復が続いていると受け止められたことから、主要株価は序盤から堅調な動きとなった。また、原油価格が上昇したことでエネルギー関連株が上昇したことも、全体を押し上げる要因となった。



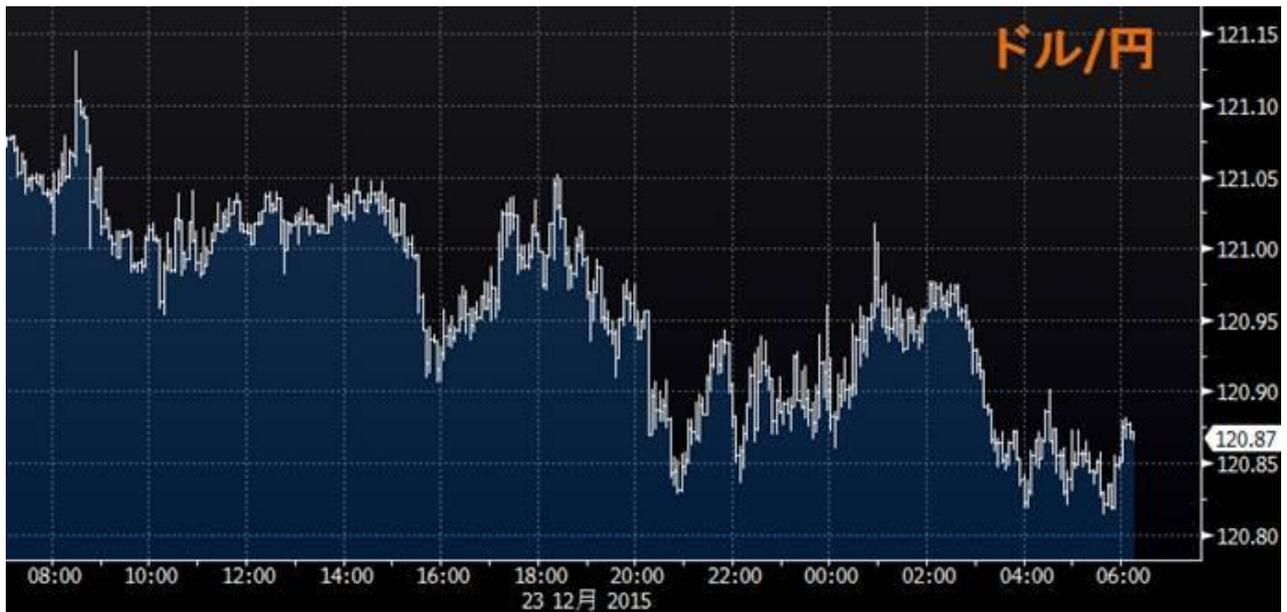
(出所：ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	120.88	121.02	120.82
EUR/JPY	131.91	132.06	131.50
GBP/JPY	179.70	180.17	179.54
AUD/JPY	87.51	87.55	87.15
NZD/JPY	82.13	82.20	81.78
EUR/USD	1.0915	1.0925	1.0870
AUD/USD	0.7240	0.7246	0.7209

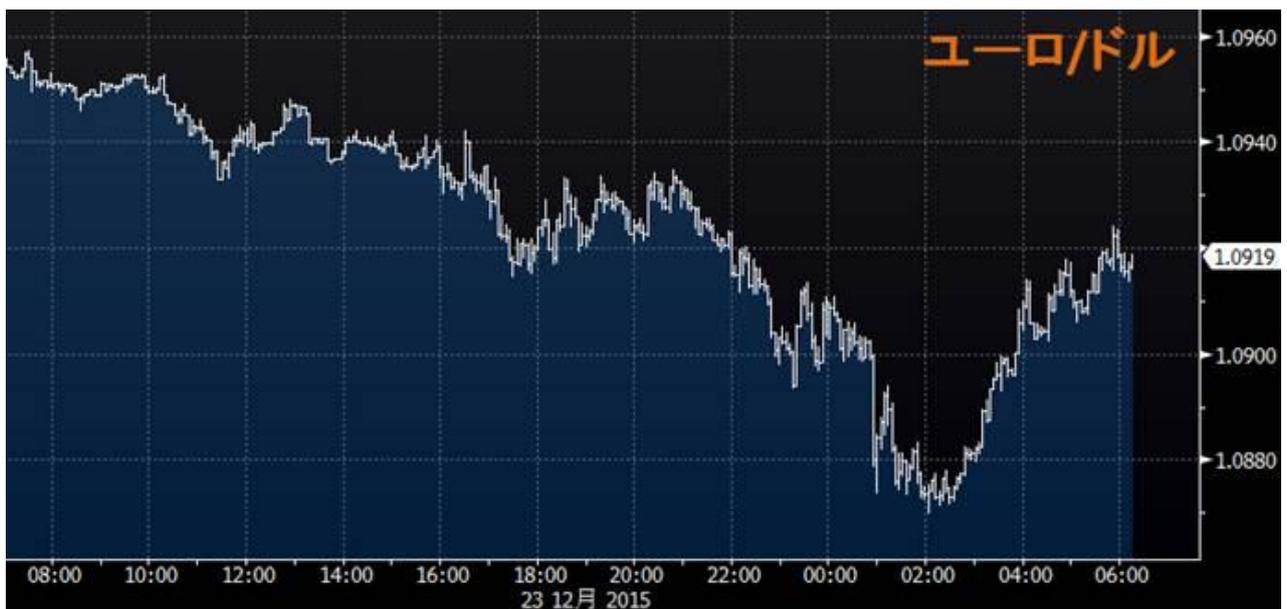
(出所：SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、クリスマス休暇の時期に入り、全般的に方向感に乏しい展開となった。序盤に米経済指標が発表されたものの、反応は限定的となった。ただ、ユーロは主要通貨の大半に対して軟調な動きとなったが、終盤には株価上昇を材料にやや値を戻す動きとなった。



(出所：ブルームバーグ)



(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。