

NY マーケットレポート (2016 年 1 月 28 日)

NY 市場では、序盤に発表された米耐久財受注が市場予想を大きく下回り、2014 年 8 月以来の大きなマイナスとなったことを受けて、米経済の鈍化の兆候が強まったとの見方が広がり、ドルは主要通貨に対して下落する動きとなった。その後、露エネルギー相の発言を受けて原油価格が大きく上昇し、資源国通貨を中心にドル円・クロス円は堅調な動きとなった。ただ、発言が一部否定されたことから、原油価格が下落となり、ドル円・クロス円も反落する動きとなった。午後には、マイナス圏まで下落していた株価が堅調な動きとなったことから、ドル円・クロス円は終盤まで底固い動きが続いた。

2016/1/28 (木)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	118.78	118.94	118.43
EUR/JPY	129.19	129.47	128.94
GBP/JPY	169.41	169.58	168.70
AUD/JPY	83.95	84.00	83.02
EUR/USD	1.0876	1.0908	1.0870

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	118.95	118.64
EUR/JPY	129.74	129.17
GBP/JPY	170.58	169.17
AUD/JPY	84.27	83.83
EUR/USD	1.0927	1.0873

*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	17041.45	-122.47
ハンセン指数	19195.83	+143.38
上海総合	2655.66	-79.90
韓国総合指数	1906.94	+9.07
豪ASX200	4976.16	+29.72
インドSENSEX指数	24469.57	-22.82
シンガポールST指数	2562.45	+16.27

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	5931.78	-58.59
仏CAC40	4322.16	-58.20
独DAX	9639.59	-241.23
ST欧州600	334.89	-5.35
西IBEX35指数	8590.60	-150.40
伊FTSE MIB指数	18189.95	-658.08
南ア 全株指数	48702.61	+778.69

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	118.84	119.00	118.58
EUR/JPY	129.97	130.22	129.52
GBP/JPY	170.58	171.17	169.86
AUD/JPY	84.17	84.81	83.95
NZD/JPY	76.99	77.48	76.63
EUR/USD	1.0938	1.0968	1.0892
AUD/USD	0.7083	0.7129	0.7069

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	16069.64	+125.18
S&P500	1893.36	+10.41
NASDAQ	4506.68	+38.51
日経225 (CME)	17075	+20
🇨🇦 トロント総合	12591.93	+214.16
🇮🇹 ボルサ指数	42393.02	+283.13
🇧🇷 ボベスバ指数	38630.19	+253.82

1/29 経済指標スケジュール

08:30	【日本】1月消費者物価指数
08:30	【日本】12月失業率12月有効求人倍率
08:50	【日本】12月鉱工業生産
09:05	【英国】1月GfK消費者信頼感調査
09:30	【オーストラリア】4Q生産者物価指数
12:00	【日本】日銀金融政策決定会合[結果公表] (時間不確定)
14:00	【日本】12月建設工事受注12月住宅着工戸数
15:30	【フランス】4Q GDP
16:00	【ドイツ】12月小売売上高指数
16:45	【フランス】1月消費者物価指数12月生産者物価指数
17:00	【トルコ】12月貿易収支
18:00	【ノルウェー】12月小売売上高
18:00	【ノルウェー】1月失業率
19:00	【欧州】1月消費者物価指数
21:00	【南アフリカ】12月財政収支12月貿易収支
22:00	【ポーランド】1月消費者物価指数
22:30	【カナダ】11月GDP
22:30	【カナダ】12月原料価格指数12月鉱工業製品価格
22:30	【米国】4Q GDP
22:30	【米国】4Q個人消費
23:00	【米国】1月ミルウォーキー購買部協会景気指数
23:00	【メキシコ】4Q GDP
23:45	【米国】1月シカゴ購買部協会景気指数
00:00	【米国】1月ミシガン大学消費者信頼感指数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1116.10	-0.20
NY 原油	33.22	+0.92
CMEコーン	365.50	-3.75
CBOT 大豆	867.75	-15.25

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.82%	0.83%
3年債	1.03%	1.05%
5年債	1.40%	1.41%
7年債	1.72%	1.74%
10年債	1.98%	1.99%
30年債	2.79%	2.79%

1/29 主要会議・講演・その他予定

- ・黒田日銀総裁 定例会見
- ・サンフランシスコ連銀総裁 講演

(出所:SBILM)

NY 市場レポート

欧州タイム

21 : 00

《企業決算》

米フォード

第 4 四半期調整後の 1 株利益は 0.58 ドル（予想 0.51 ドル）

キャタピラー

第 4 四半期調整後の 1 株利益は 0.74 ドル（予想 0.69 ドル）

アリババ

第 3 四半期調整後の 1 株利益は 6.43 元（予想 5.81 元）

22:00

ドル/円 118.88 ユーロ/円 129.64 ユーロ/ドル 1.0905

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	5948.18	-42.19	ダウ 先物ミニ	15894	+43
仏 CAC40	4338.18	-42.18	S&P 500 ミニ	1882.75	+7.75
独 DAX	9738.97	-141.85	NASDAQ 100 ミニ	4103.00	+36.00

(出所:SBILM)

22 : 00

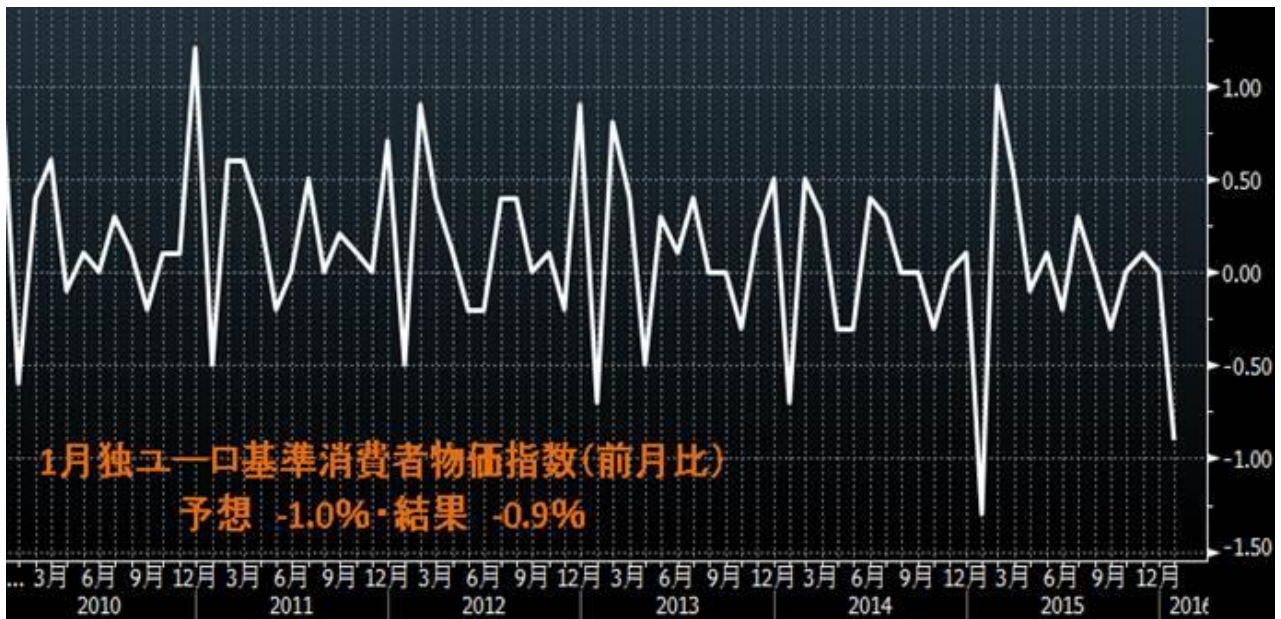
《 経済指標の結果 》

1 月独消費者物価指数（前月比） -0.8%（予想 -0.8%・前回 -0.1%）

1 月独消費者物価指数（前年比） 0.5%（予想 0.4%・前回 0.3%）

1 月独ユーロ基準消費者物価指数（前月比） -0.9%（予想 -1.0%・前回 0.0%）

1 月独ユーロ基準消費者物価指数（前年比） 0.4%（予想 0.4%・前回 0.2%）



(出所：ブルームバーグ)



(出所：ブルームバーグ)

22 : 22

《 経済指標の結果 》

南ア政策金利発表 6.75% (予想 6.75%・前回 6.25%)



(出所：ブルームバーグ)

22 : 30

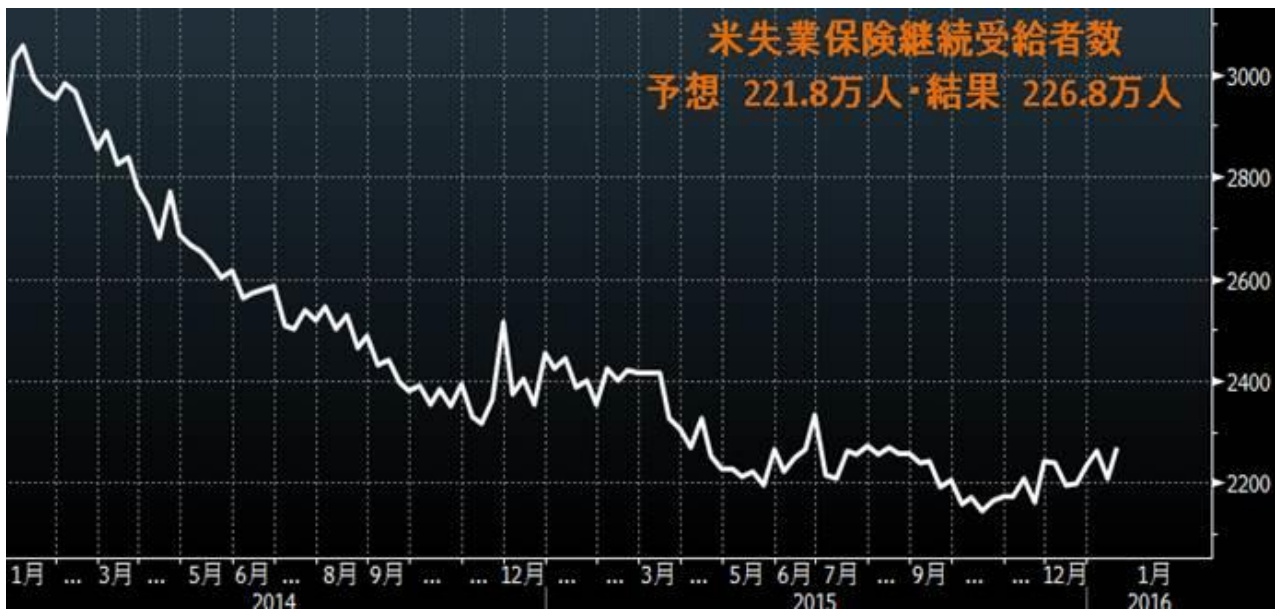
◀ 経済指標の結果 ▶

米新規失業保険申請件数 27.8 万件 (予想 28.1 万件・前回 29.4 万件)
 前回発表の 29.3 万件から 29.4 万件に修正

米失業保険継続受給者数 226.8 万人 (予想 221.8 万人・前回 221.9 万人)
 前回発表の 220.8 万人から 221.9 万人に修正



(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

16/01/23	278,000	-16,000	283,000	*****
16/01/16	294,000	+11,000	285,000	2,268,000・1.7%
16/01/09	283,000	+6,000	278,500	2,219,000・1.6%
16/01/02	277,000	-10,000	275,750	2,264,000・1.7%
15/12/26	287,000	+20,000	277,000	2,234,000・1.6%
15/12/19	267,000	-5,000	272,500	2,205,000・1.6%
15/12/12	272,000	-10,000	270,750	2,195,000・1.6%
15/12/05	282,000	+13,000	270,750	2,242,000・1.7%
15/11/28	269,000	+9,000	269,250	2,245,000・1.7%
15/11/21	260,000	-12,000	271,000	2,161,000・1.6%
15/11/14	272,000	-4,000	271,000	2,155,000・1.6%
15/11/07	276,000	0	267,750	2,173,000・1.6%

受給者数は集計が1週間遅れる

22:30

《経済指標の結果》

12月米耐久財受注(前月比) -5.1% (予想 -0.7%・前回 -0.5%)

前回発表の0.1%から-0.5%に修正

12月米耐久財受注[除輸送用機器] -1.2% (予想 -0.1%・前回 -0.5%)

前回発表の0.1%から-0.5%に修正



(出所：ブルームバーグ)

経済指標データ

《米耐久財受注》	12月	11月	10月	9月	8月	7月
耐久財新規受注	-5.1	-0.5	2.8	-0.8	-2.9	1.9
輸送機器除く	-1.2	-0.5	0.5	-0.1	-0.9	0.4
国防関連除く	-2.9	-2.0	3.0	-1.6	-2.1	0.8
資本財	-18.0	-2.4	10.9	-4.3	-7.0	3.0
輸送機器	-12.4	-0.5	7.6	-2.2	-6.9	4.9
総受注残	-0.5	0.1	0.3	-0.5	-0.3	0.2
総在庫	0.5	-0.2	-0.3	-0.6	-0.2	0.0
総出荷	-2.2	0.6	-1.2	0.3	-0.5	1.0

23 : 15

《 要人発言 》

露エネルギー相

- ・「OPEC 会合、5%減産を協議の可能性も」
- ・「サウジ、先に 5%減産を提案していた」

23 : 33

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	16063.28	+118.82
ナスダック	4527.51	+59.34

(出所：SBILM)

0 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

12 月米中古住宅販売成約（前月比） 0.1%（予想 0.9%・前回 -1.1%）
 前回発表の-0.9%から-1.1%に修正

12 月米中古住宅販売成約（前年比） 3.1%（予想 4.8%・前回 4.9%）
 前回発表の 5.1%から 4.9%に修正



(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

《中古住宅販売仮契約》

	12月	11月	10月	9月	8月	7月
全米	0.1	-1.1	0.4	-1.6	-1.4	0.5
北東部	6.1	-2.5	5.6	-4.0	-5.6	4.0
中西部	-1.1	0.8	-1.0	-2.5	-0.4	0.0
南部	-0.5	1.3	-1.4	-1.1	-2.3	0.6
西部	-2.1	6.2	1.7	-0.2	1.6	-1.3

(前月比%)

	12月	11月	10月	9月	8月	7月
全米	3.1	4.9	2.3	3.2	6.6	7.2
北東部	13.0	8.5	5.7	2.8	8.0	12.3
中西部	2.7	7.0	1.4	3.2	6.2	5.4
南部	0.9	1.3	-0.6	1.2	5.2	5.3
西部	2.0	7.6	6.4	6.5	9.0	9.2

(前年比%)

0:40

湾岸諸国の OPEC 代表

- ・「サウジ、5%減産の提案はない」
- ・「サウジ、すべての産油国と協調の可能性閉ざさず」

1:00

《 経済指標の結果 》

1月カンザスシティ連銀製造業活動指数 -9 (予想 -10・前回 -9)



(出所：ブルームバーグ)

<< 経済指標のポイント >>

(1) 独連邦統計局が発表した1月の消費者物価指数の速報値は、EU基準で前月比-0.9%となり、下落率は2015年1月以降で最大となった。原油価格の急落と新興国市場経済の弱さがインフレ回復を遠のける結果となった。1月の消費者物価指数は、前年同月比で+0.4%となり、前年比のインフレ率は前月の0.2%を上回った。

(2) 南アフリカ中銀は、通貨ランドの下落によるインフレ圧力が経済全体に広がることを懸念し、政策金利を従来の6.25%から市場の予想通り0.50ポイント引き上げ6.75%とした。ランドの対ドル相場は、昨年11月の前回の政策決定以降に15%下落しており、中銀にこれまでよりも大幅な利上げを促した。

(3) 12月の米耐久財受注は、市場予想の-0.6%を大きく下回る前月比-5.1%の2254億2200万ドルとなり、2ヵ月連続のマイナスとなった。輸送機器が落ち込んだほか、一般機械なども減少したことから全体を押し下げた。また、前回の結果は、横ばいから-0.5%へ下方修正された。

①輸送機器が-12.4%となり、変動の激しい国防関連の航空機が-69.1%、民間航空機が-29.4%、自動車・同部品は-0.4%だった。

輸送機器を除いた受注は-1.2%となり、電算機・電子機器が-2.0%、一般機械が-5.6%、電機・家電は+2.1%、一次金属は+0.3%となった。

②資本財は-18.0%となり、資本財から国防関連を除いた受注は-15.0%、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-4.3%、国防関連は-34.4%となった。

③耐久財全体の出荷高は-2.2%、受注残高は-0.5%、在庫高は+0.5%だった。また、2015年の耐久財受注（季節調整前）は、前年比-3.5%の2兆7957億3200万ドルとなった。

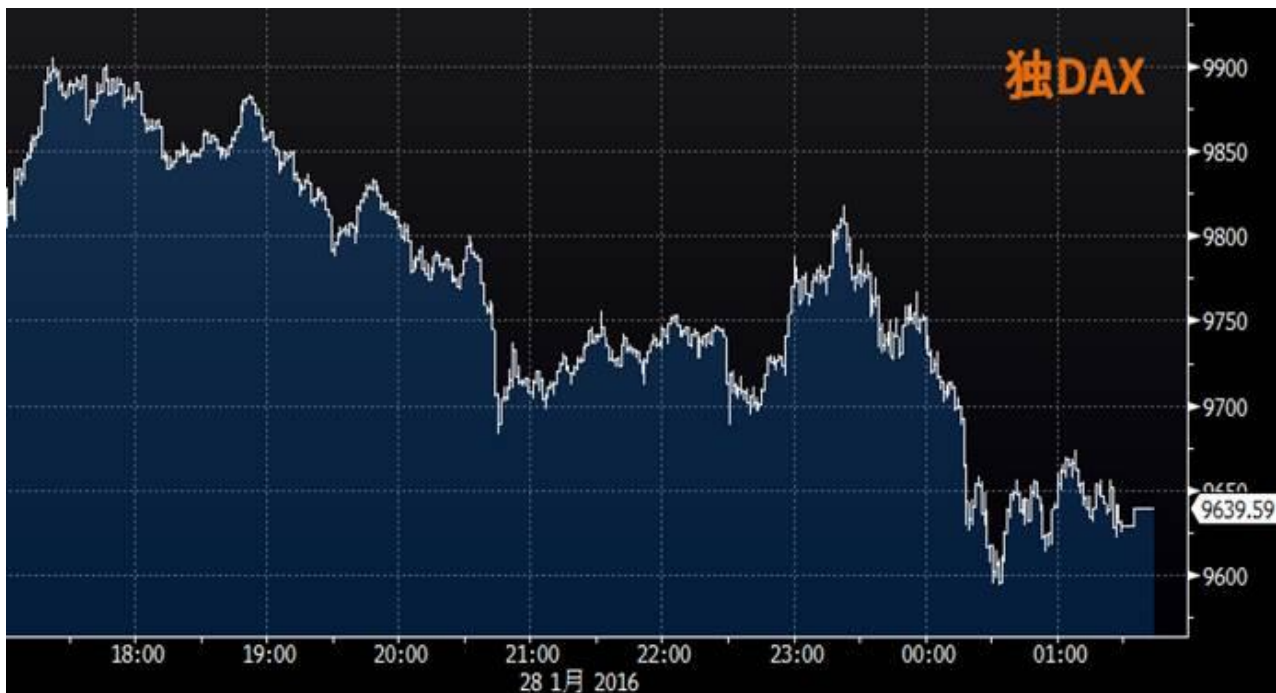
(4) 米失業保険申請件数は、前週比-1.6万件的27.8万件的となり、3週ぶりに減少した。昨年3月7日までの週以降47週連続で30万人を下回って推移している。申請件数の4週移動平均は、前週比-2250件の28.3万件的。また、集計が1週遅れる失業保険継続受給者数は、前週比+4.9万人的226.8万人的となり、昨年8月1日までの週以来の高い水準となった。受給者総数の4週移動平均は、前週比+1万5750人的224万6250人。受給者比率は、前週比0.1ポイント上昇の1.7%だった。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	5931.78	-58.59
仏 CAC40	4322.16	-58.20
独 DAX	9639.59	-241.23
ストック欧州 600 指数	334.89	-5.35
ユーロファースト 300 指数	1318.22	-22.54
スペイン IBEX35 指数	8590.60	-150.40
イタリア FTSE MIB 指数	18189.95	-658.08
南ア アフリカ全株指数	48702.61	+778.69

(出所:SBILM)

<< 欧州株式市場 >>

欧州株式市場は、欧州企業の業績先行き懸念で売りが広がった。また、米追加利上げの可能性が消えていないとの見方も相場を圧迫し、主要株価は軒並み下落となった。



(出所：ブルームバーグ)

2 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 15947.95 (+3.49)、S&P500 1881.01 (-1.94) ナスダック 4490.23 (+22.07)

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、12月の米耐久財受注が市場予想を大きく下回ったことで米景気の先行き不安が広がり、安全資産とされる米国債を買う動きが出る一方、原油先物相場の上昇を背景に売りも出たことから、もみ合いの展開が続いた。

午前の利回りは、30年債が2.80%（前日2.80%）、10年債が2.00%（2.00%）、7年債が1.75%（1.75%）、5年債が1.42%（1.41%）、3年債が1.05%（1.05%）、2年債が0.83%（0.84%）。

3 : 00

《米財務省7年債入札》

最高落札利回り・・・1.759%（前回 2.161%）
最低落札利回り・・・1.588%（前回 1.888%）
最高利回り落札比率・・・60.94%（前回 69.43%）
応札倍率・・・2.63倍（前回 2.34倍）

5 : 20

NY金は、中心限月が前日比0.20ドル安の1オンス=1116.10ドルで取引を終了した。

5 : 30

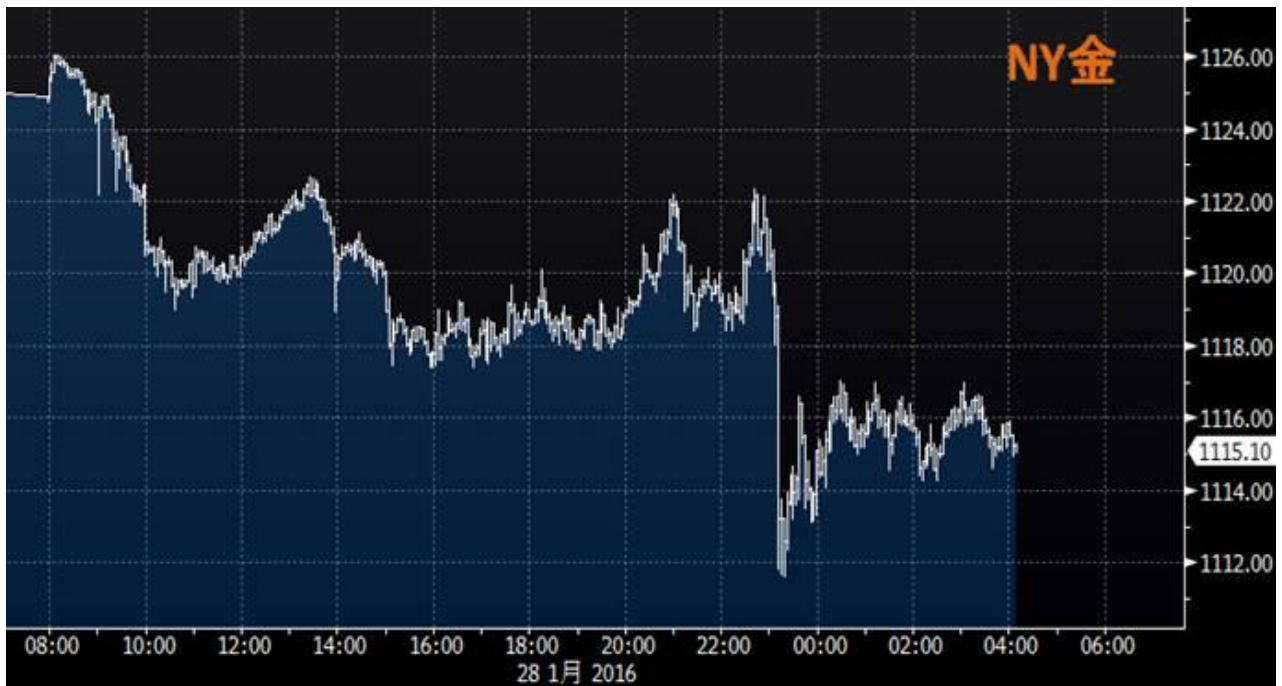
NY原油は、中心限月が前日比0.92ドル高の1バレル=33.22ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1116.10	-0.20
NY 原油	33.22	+0.92

(出所: SBILM)

《 NY 金市場 》

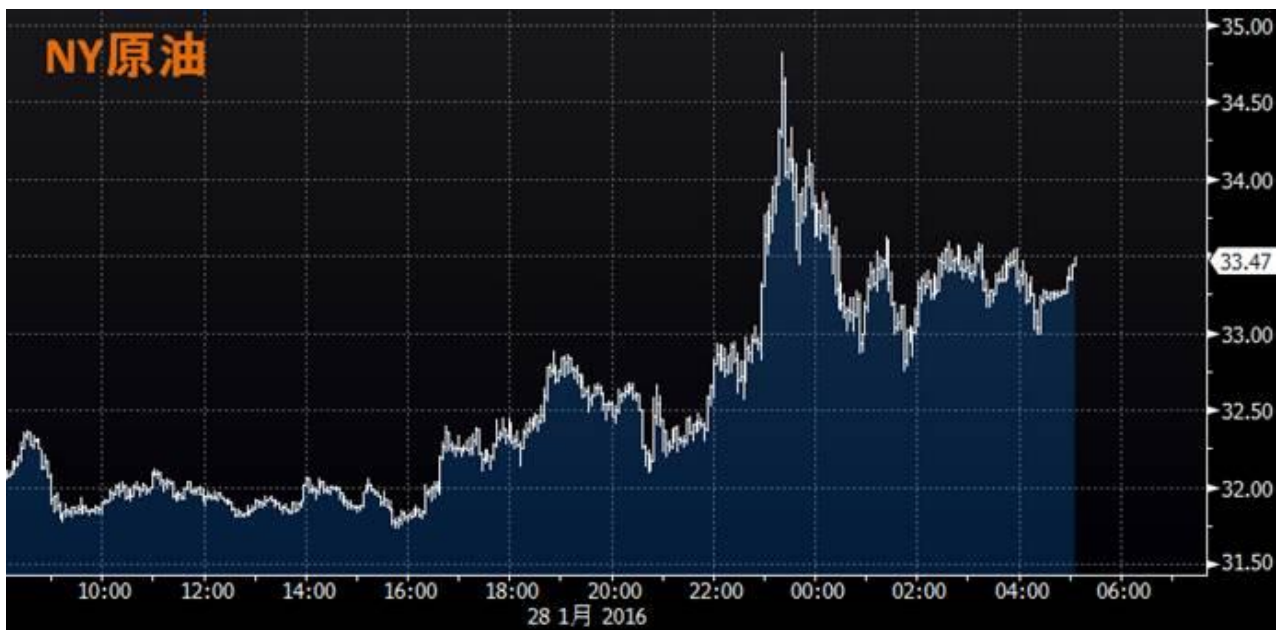
NY 金は、原油先物や米国株の上昇で投資家がリスク志向を強め、比較的安全な資産とされる金を売る動きがやや優勢となった。



(出所: ブルームバーグ)

《 NY 原油市場 》

NY 原油は、サウジアラビアから協調減産の提案があったとするロシアのエネルギー相の発言で買いが優勢となったが、その後は協調減産の実現に対して懐疑的な見方も広がり、相場の上げ幅は縮小した。一時 1 バレル=34.82 ドルまで上昇し、約 3 週間ぶりの高値水準をつける場面もあった。



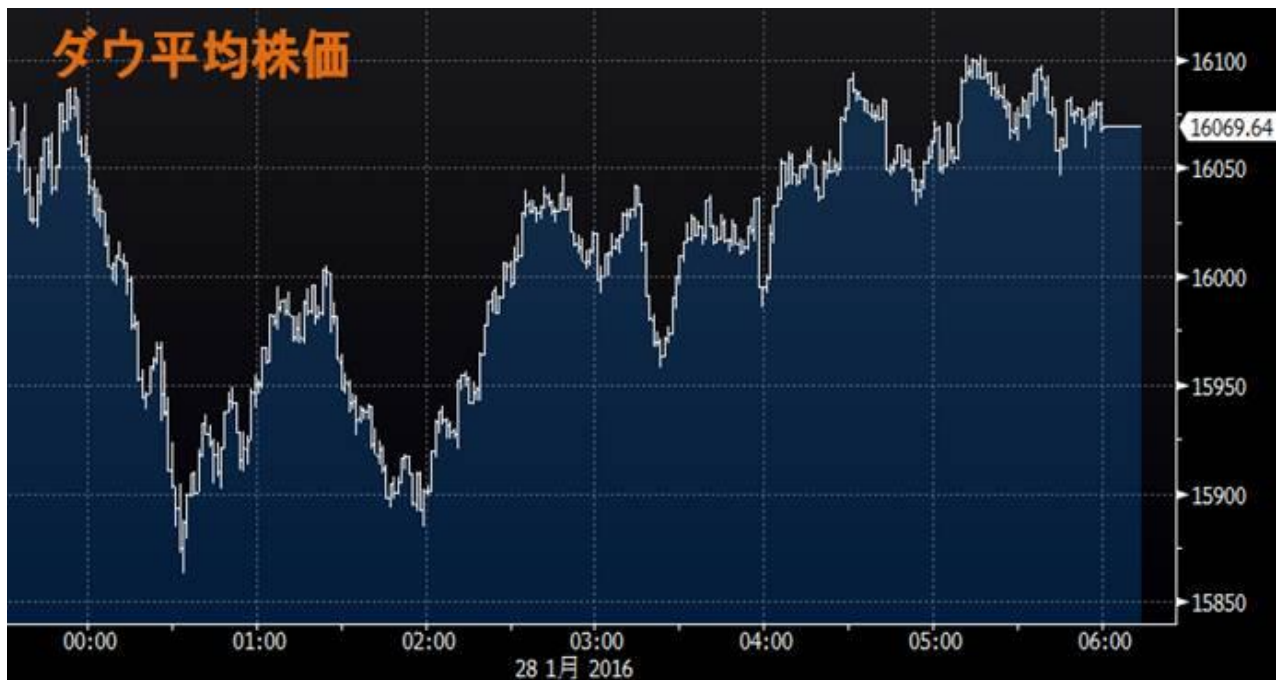
(出所：ブルームバーグ)

主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	16069.64	+125.18	16102.14	15863.72
S&P500 種	1893.36	+10.41	1902.96	1873.65
ナスダック	4506.68	+38.51	4533.81	4447.50

(出所：SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、原油先物価格が一時上昇したことで、収益改善期待から石油株が買われるなど、序盤の主要株価は堅調な動きとなった。また、IT 大手の決算が好調だったことも支援材料となった。その後、原油価格が反落したことから、一時マイナス圏まで下落する場面もあったが、午後には再び堅調な動きとなった。



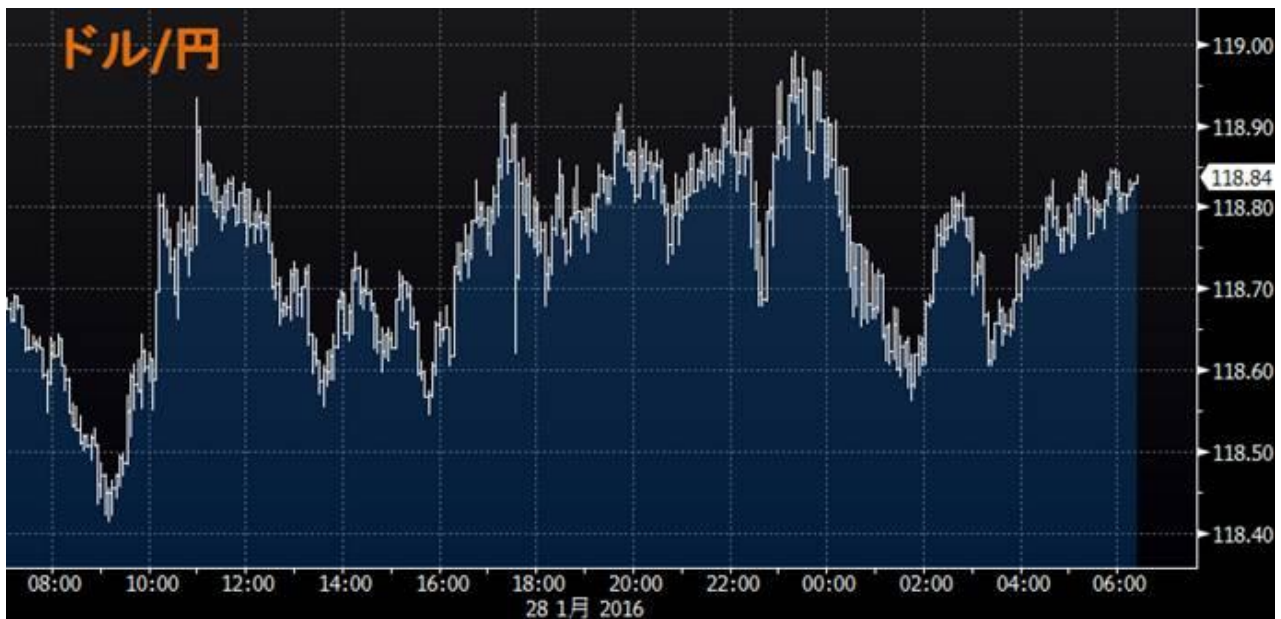
(出所：ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	118.84	119.00	118.58
EUR/JPY	129.97	130.22	129.52
GBP/JPY	170.58	171.17	169.86
AUD/JPY	84.17	84.81	83.95
NZD/JPY	76.99	77.48	76.63
EUR/USD	1.0938	1.0968	1.0892
AUD/USD	0.7083	0.7129	0.7069

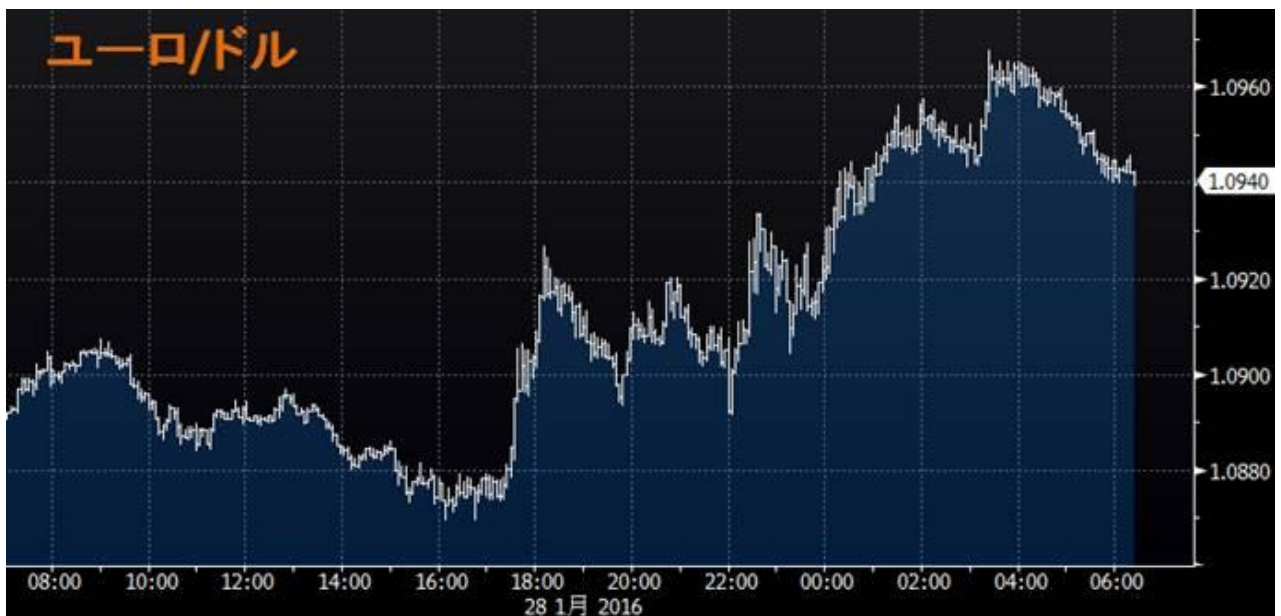
(出所：SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、序盤は米耐久財受注が大きく低下したこと、ドルが主要通貨に対して下落する動きとなった。しかし、原油価格や株価が上昇したこと、ドル円・クロス円は堅調な動きとなった。ただ、その後、株価が下落したこと、軟調な動きとなったが、午後には再び株価が上昇に転じたことから、底固い動きとなった。



(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自身でお願いします。