

NY マーケットレポート (2017年3月29日)

英国が EU 離脱を正式に通告したことを受けて、離脱条件を定める協定や新たな自由貿易協定を話し合う原則 2 年の交渉が始まった。ただ、交渉の難航が予想されていることもあり、ポンドは主要通貨に対して軟調な動きとなった。また、ECB 当局者が政策メッセージを変えることに慎重になっているとの報道を受けて、ユーロも主要通貨に対して下落し、相対的に円が買われる動きとなった。

その後、石油の在庫統計を受けて、原油価格が上昇したことを好感して、資源国通貨を中心に堅調な動きとなり、ドル円・クロス円も堅調な動きとなった。しかし、米債券利回りが低下したこともあり、ドル/円はやや上値の重い動きとなった。

2017年3月29日(水)

TOKYO	終値	高値	安値
USD/JPY	111.10	111.32	111.03
EUR/JPY	119.82	120.44	119.73
GBP/JPY	137.82	138.51	137.61
AUD/JPY	85.08	85.16	84.76
EUR/USD	1.0785	1.0827	1.0778

LONDON	高値	安値
USD/JPY	111.21	110.72
EUR/JPY	119.97	119.06
GBP/JPY	138.34	137.82
AUD/JPY	85.12	84.68
EUR/USD	1.0794	1.0748

*東京クローズ～NYオープンまでの高安

NEW YORK	終値	高値	安値
USD/JPY	111.03	111.15	110.76
EUR/JPY	119.55	119.58	119.02
GBP/JPY	138.12	138.20	137.53
AUD/JPY	85.17	85.27	84.70
NZD/JPY	78.08	78.15	77.73
EUR/USD	1.0768	1.0773	1.0740
AUD/USD	0.7671	0.7675	0.7643

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	20659.32	-42.18
S&P500	2361.13	+2.56
NASDAQ	5897.55	+22.41
日経225 (CME)	19165	-20
トロント総合	15657.63	+59.06
ボルサ指数	49036.52	-302.72
ボベスパ指数	65528.29	+887.84

3/30 経済指標スケジュール

08:50	【日本】対内外証券投資
09:00	【オーストラリア】2月HIA新築住宅販売
15:00	【ノルウェー】2月小売売上高
15:00	【南アフリカ】2月民間部門信用
15:00	【南アフリカ】2月マネーサプライM3
16:00	【トルコ】3月経済信頼感
16:00	【スイス】3月KOF先行指数
17:30	【香港】2月小売売上高
18:00	【欧州】3月消費者信頼感
18:00	【欧州】3月サービス業信頼感
18:00	【欧州】3月業況判断指数
18:00	【欧州】3月鉱工業信頼感
18:00	【欧州】3月経済信頼感
18:30	【南アフリカ】2月生産者物価指数
20:00	【南アフリカ】電力消費・発電
21:00	【南アフリカ】2月財政収支
21:00	【ドイツ】3月消費者物価指数
21:30	【米国】4Q GDP
21:30	【米国】4Q個人消費
21:30	【米国】新規失業保険申請件数
21:30	【米国】失業保険継続受給者数
21:30	【カナダ】2月鉱工業製品価格
21:30	【カナダ】2月原料価格指数
22:20	【南アフリカ】政策金利発表(時間不確定)
04:00	【メキシコ】政策金利発表

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1253.70	-1.90
NY 原油	49.51	+1.14
CME コーン	358.50	+0.75
CBOT 大豆	969.00	-3.00

米国債利回り	本日	前日
2年債	1.270%	1.302%
3年債	1.517%	1.549%
5年債	1.928%	1.962%
7年債	2.198%	2.242%
10年債	2.378%	2.416%
30年債	2.987%	3.020%

ドイツ10年債	0.344%	0.388%
英国10年債	1.150%	1.192%

3/30 主要会議・講演・その他予定

- ・ダラス連銀総裁 講演
- ・クリーブランド連銀総裁 講演
- ・サンフランシスコ連銀総裁 講演

NY 市場レポート

20 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

米 MBA 住宅ローン申請指数 (前週比) -0.8% (前回 -2.7%)

20 : 30

トウスク EU 大統領～EU は、英国が提出した正式離脱通告の書簡を受理した。



出所 : Net Dania

21 : 25

ズマ南ア大統領のゴードン財務相の解雇の計画に3党首が反対。



出所 : Net Dania

22:25

◀ 要人発言 ▶

エバンス・シカゴ連銀総裁

- ・「今年あと1回もしくは2回の利上げを支持」
- ・「企業景況感の上昇は設備投資の拡大につながる可能性」
- ・「インフレは19年まで持続的に2%を達成すると再表明」
- ・「インフレ期待値を2%に上昇させるのは非常に重要」
- ・「今四半期のデータの弱い数字は一過性のものだろう」
- ・「インフレ率の一時的な2.5%上昇はFOMCの目標と整合」

23:00

◀ 経済指標の結果 ▶

2月米中古住宅販売仮契約（前月比） 5.5%（予想 2.5%・前回 -2.8%）

2月米中古住宅販売仮契約（前年比） -2.4%（前回 2.7%）



出所：Bloomberg

経済指標データ

◀ 中古住宅販売仮契約 ▶

	2月	1月	12月	11月	10月	9月
全米	5.5	-2.8	0.8	-1.3	0.1	0.7
北東部	3.4	2.3	1.3	1.0	0.0	-0.6
中西部	11.4	-5.0	-0.3	-1.7	1.2	0.3
南部	4.3	0.4	1.6	-0.9	-0.7	1.0
西部	3.1	-9.8	2.0	-3.3	0.5	1.9
(前月比%)						
	2月	1月	12月	11月	10月	9月
全米	-2.4	2.7	-2.0	1.4	0.2	2.0
北東部	1.4	5.9	-3.1	8.8	1.8	7.5
中西部	-5.4	-0.1	-5.8	-0.7	-0.9	-0.9
南部	-0.2	4.1	-1.6	0.6	-0.5	0.5
西部	-5.3	1.2	1.9	0.0	1.2	4.4
(前年比%)						

23 : 30

≪ EIA 米週間在庫統計 ≫

原油在庫・・・86.7万バレル増加
 ガソリン在庫・・・375万バレル減少
 留出油在庫・・・248万バレル減少
 クッシングの原油在庫・・・22.0万バレル減少

≪ 経済指標のポイント ≫

NAR（全米不動産業者協会）が発表した2月の中古住宅販売仮契約指数は、前月比+5.5%の112.3（2001年=100）となり、2カ月ぶりのプラスとなった。前月の1年ぶりの低水準から、一転して2010年4月以来の高い伸びとなった。地域別では、中西部が+11.4%、南部が+4.3%、北東部が+3.4%、西部が+3.1%だった。仮契約は通常1-2カ月以内に本契約に移行するため、NARの仮契約指数は中古住宅市場の先行指数とされる。同時に発表された4月の中古住宅販売見通しでは、2017年の販売件数は前年比+2.3%、2018年は+3.3%を見込んでいる。また、中間販売価格は2017年が+4.2%、2018年は+3.1%と予測されている。

0 : 35

≪ 要人発言 ≫

ローゼングレン・ポストン連銀総裁

- ・「熱すぎる景気を作らないことが大事だ」
- ・「今年は隔年会での利上げ(年4回)が好ましい」
- ・「融資は幾分か減速すると予想される」
- ・「イーールドカーブに注意を払っている」
- ・「利上げに長期金利が反応しなければ驚くべき事象だろう」

≪ 欧州のポイント ≫

英政府は、EUからの離脱をEUに正式通知した。EUから加盟国が離脱するのは初めてとなり、これにより離脱条件を定める協定や、新たな自由貿易協定（FTA）を話し合う原則2年の交渉が始まった。離脱通知は、EU基本条約「リスボン条約」で加盟国の離脱手続きを定めた第50条に基づくもの。英国とEUは優先課題について対立しており、交渉の難航は必至とみられている。メイ英首相が署名した通知文書を、EUのトゥスクEU大統領に手渡した。これを受け、メイ首相は英議会下院で演説し通知を報告した。

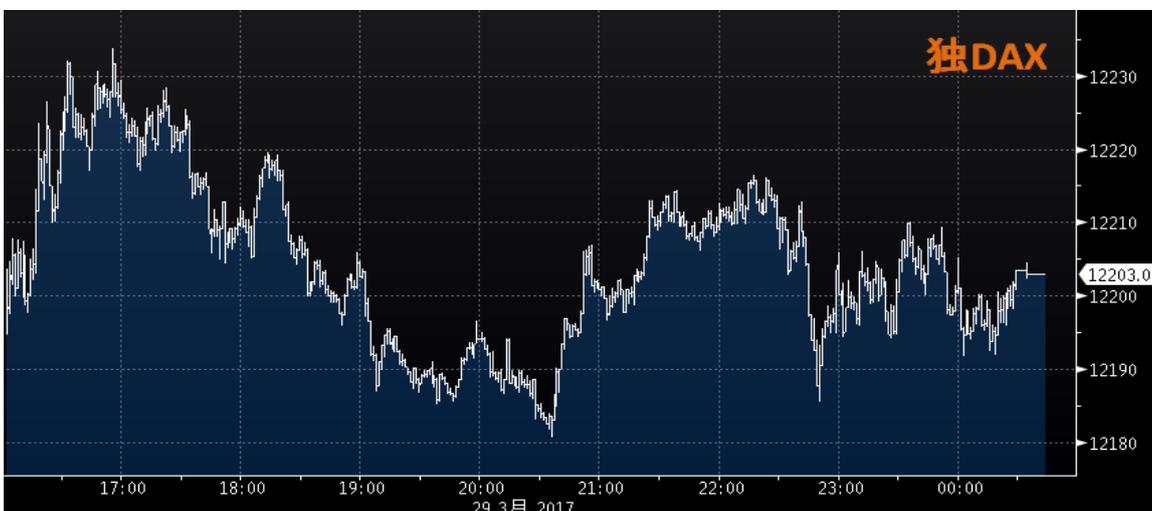
2 : 00

≪ 米財務省7年債入札 ≫

最高落札利回り・・・2.215%（前回 2.197%）
 最低落札利回り・・・1.888%（前回 1.888%）
 最高利回り落札比率・・・19.22%（前回 70.83%）
 応札倍率・・・2.56倍（前回 2.49倍）

≪ 欧州株式市場 ≫

欧州株式市場は、原油の値上がりなどが市場心理を下支えたことから、独DAX指数など主要株価は堅調な動きとなった。英FT100指数は、英国のEU離脱通知が意識され売られる場面もあった。



出所：Bloomberg

3 : 00

◀ 要人発言 ▶

ローゼングレン・ボストン連銀総裁～インタビュー

- ・「賃金と資産価格でインフレ懸念が見られる」
- ・「一部の資産市場はやや割高」
- ・「4回の利上げは前回の引き締め局面より漸進的」

- ・「経済は年4回の利上げに耐え得る」
- ・「インフレ目標はターゲットであり天井ではない」
- ・「商業用不動産はかなり割高」

- ・「割高な資産価格は、引き締め加速の根拠になる」
- ・「景気が軟化すれば、年内4回の利上げは望まない」

3 : 50

◀ 要人発言 ▶

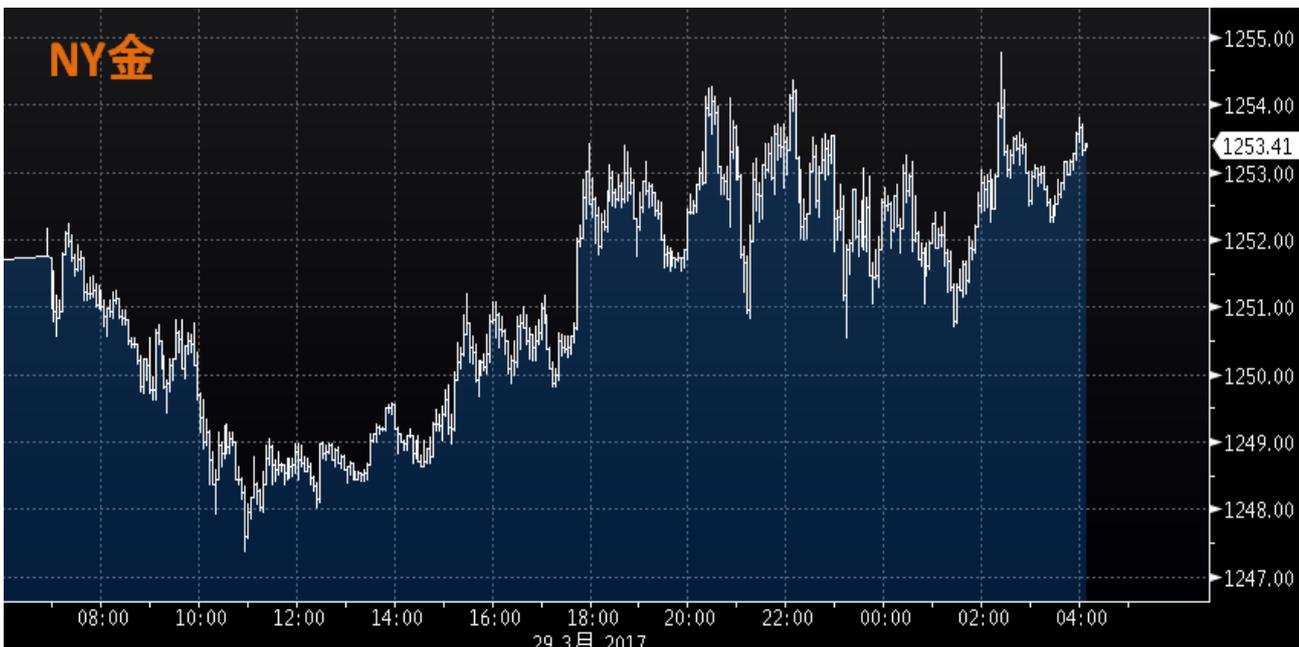
ウィリアムズ・サンフランシスコ連銀総裁

- ・「今年3回を超える利上げはあり得る」
- ・「失業率は、年末までに4.5%で底入れすると予想」
- ・「景気過熱を防ぐことがFOMCの役割」
- ・「今年は恐らく3-4回利上げへ」
- ・「欧州の改善は米国にとってポジティブとなり得る」

◀ NY金市場 ▶

NY金は、中心限月が前日比1.90ドル安の1オンス=1253.70ドルで取引を終了した。

NY金はドルがユーロなどに対して上昇したことからドルの代替資産とされる金の売りが先行した。ただ、トランプ米政権の経済政策や英国のEU離脱交渉を巡る先行き不透明感から買いも見られた。

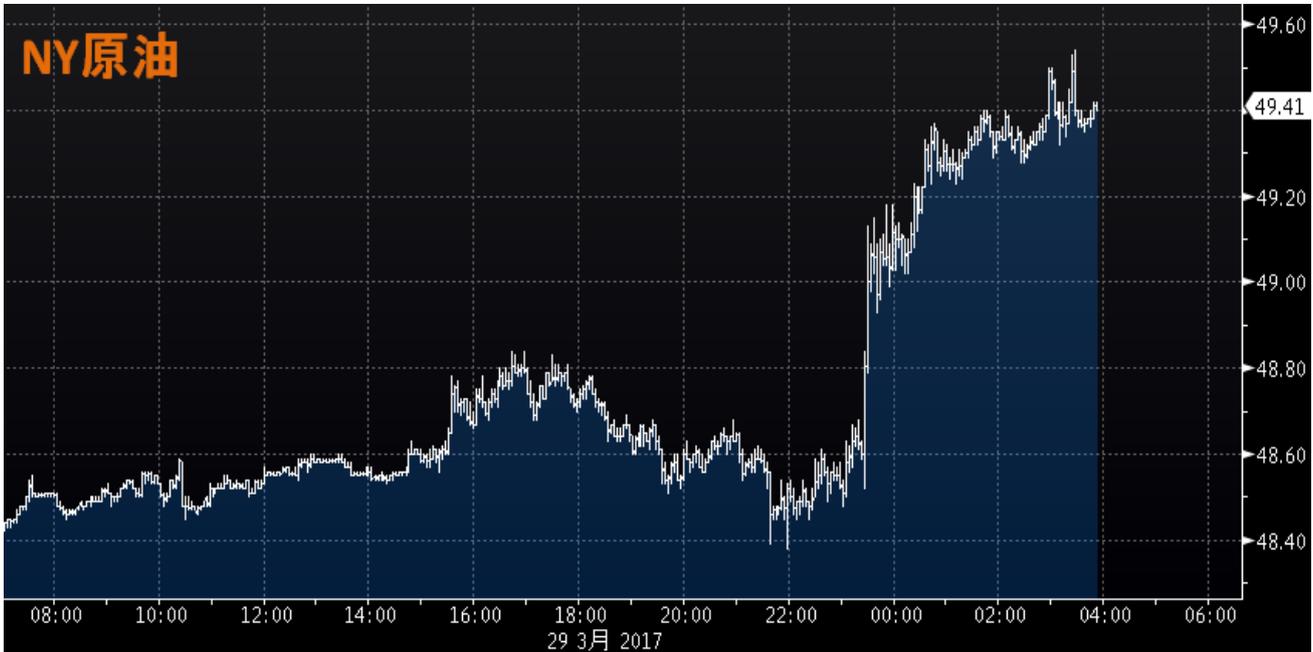


出所：Bloomberg

◀ NY 原油市場 ▶

NY 原油は、中心限月が前日比 1.14 ドル高の 1 バレル=49.51 ドルで取引を終了した。

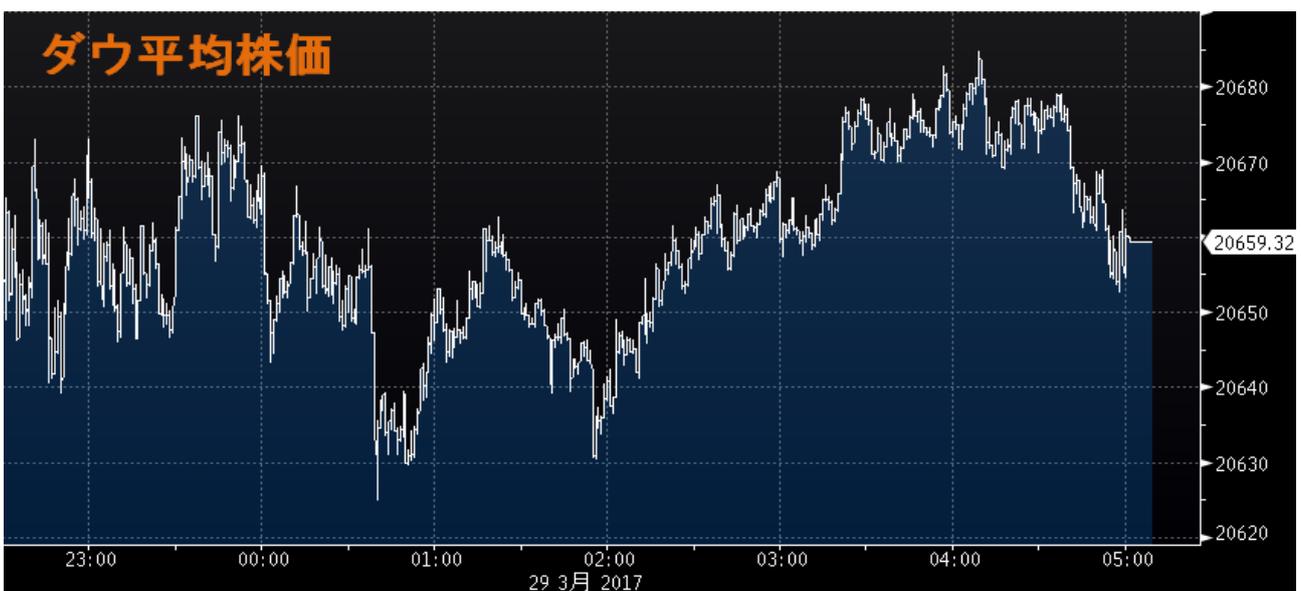
NY 原油は、米石油統計で原油在庫が市場の予想ほど増えなかったことに加え、ガソリン在庫は予想以上に減少したことから需給引き締めへの期待感から買い優勢となった。また、OPEC と非加盟国の協調減産が延長されるとの観測も支援材料となった。



出所：Bloomberg

◀ 米株式市場 ▶

米株式市場は、新規材料に乏しい中、前日までの上昇を受けて当面の利益を確定させるための売りが先行した。その後は値を戻す動きとなり、ナスダックはプラス圏に値を戻し底固い動きが続いた。一方、ダウ平均株価は序盤から軟調な動きとなり、一時前日比 62 ドル安まで下落したが、その後下げ幅を縮小したものの小幅安で引けた。



出所：Bloomberg

＜外国為替市場＞

外国為替市場は、英国が EU 離脱を通告したことを受けて、リスク回避の動きが優勢となったことが影響し、NY 市場の序盤まで軟調な動きとなった。その後は、反動で緩やかながら値を戻す動きとなった。また、原油価格が上昇したことも影響し、資源価格を中心に堅調な動きとなった。



出所：総合分析チャート

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。