

NY マーケットレポート (2017年11月1日)

NY 市場では、序盤に発表された米 ADP 雇用統計で、雇用者数の伸びが市場予想を上回り、3月以来の高い伸びとなった。そして、2つの大型ハリケーン襲来の影響からの回復が示唆されたことを受けて、週末の米雇用統計への期待も意識され、ドルは堅調な動きとなった。

しかし、その後に発表された米 ISM 製造業景況指数が市場予想を下回る結果となったことを受けて、ドルは軟調な動きとなった。また、米国債利回りが低下したことも影響し、クロス円も軟調な動きとなった。そして、注目された米 FOMC では、政策金利は据え置きとなったが、「経済活動は“堅調”に拡大している」と景気認識を上方修正し、「労働市場も力強さを増している」と指摘したことで、12月の利上げ期待が一段と押し上げられ、日米金利差拡大が意識されたことで円売りが優勢となり、ドル円・クロス円は堅調な動きとなった。

2017年11月1日 (水)

TOKYO	終値	高値	安値
USD/JPY	113.90	113.97	113.61
EUR/JPY	132.73	132.74	132.35
GBP/JPY	151.59	151.60	150.94
AUD/JPY	87.44	87.46	86.95
EUR/USD	1.1652	1.1655	1.1626

アジア主要株価	終値	前日比
日経平均	22420.08	+408.47
ハンセン指数	28594.06	+348.52
上海総合	3395.91	+2.57
豪ASX200	5937.77	+28.75
インドSENSEX	33600.27	+387.14

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	7487.96	-5.12
仏CAC40	5514.29	+11.00
独DAX	13465.51	+235.94

米国主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	23435.01	+57.77
S&P500	2579.36	+4.10
NASDAQ	6716.54	-11.13

NEW YORK	終値	高値	安値
USD/JPY	114.10	114.28	113.76
EUR/JPY	132.63	132.84	132.43
GBP/JPY	151.16	151.93	151.02
AUD/JPY	87.58	87.72	87.37
EUR/USD	1.1622	1.1643	1.1607

南北米主要株価	終値	前日比
トロント総合	16029.33	+3.75
ボルス指数	48334.45	-291.08
ボベスパ指数	73823.75	-484.74

*一部暫定値

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1277.30	+6.80
NY 原油	54.30	-0.08

11/2 経済指標スケジュール

08:50	【日本】10月マネタリーベース
08:50	【日本】10月対内外証券投資
09:30	【オーストラリア】9月貿易収支
09:30	【オーストラリア】9月住宅建設許可件数
14:00	【日本】10月消費者態度指数
15:45	【スイス】10月SECO消費者信頼感指数
17:50	～ 18:00
	【フランス】【ドイツ】【欧州】10月製造業PMI
17:55	【ドイツ】10月失業率
17:55	【ドイツ】10月失業者数
18:30	【英国】10月建設業PMI
20:00	【南アフリカ】9月発電
20:00	【南アフリカ】9月電力消費
20:30	【米国】10月チャレンジャー人員削減数
21:00	【英国】政策金利発表
21:00	【英国】11月英中銀議事録
21:00	【英国】英中銀四半期インフレ報告
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
22:00	【シンガポール】10月購買部景気指数
22:00	【シンガポール】10月電子産業指数

米国債利回り	本日	前日
2年債	1.61%	1.60%
3年債	1.73%	1.73%
5年債	2.02%	2.01%
7年債	2.22%	2.23%
10年債	2.37%	2.38%
30年債	2.86%	2.87%

ドイツ10年債	0.37%	0.36%
英国10年債	1.34%	1.33%

11/2 主要会議・講演・その他予定

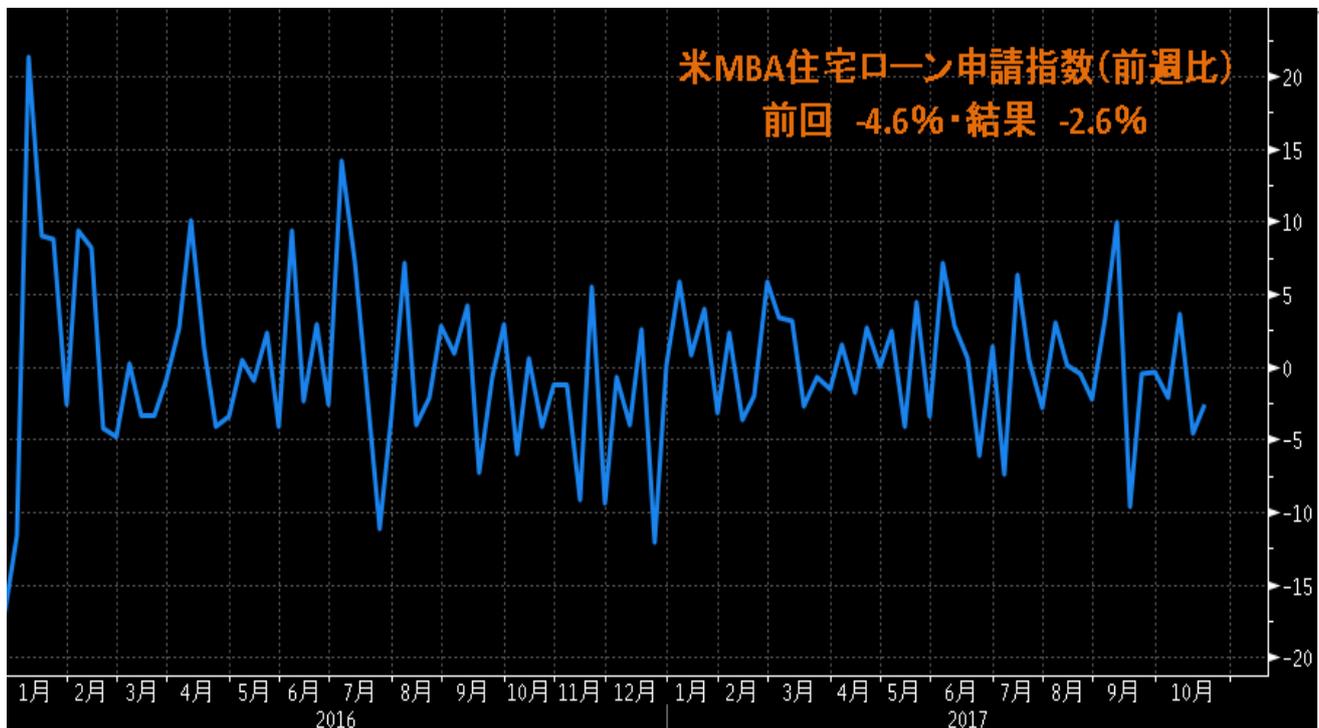
- ・カーニー英中銀総裁 会見
- ・アトランタ連銀総裁 講演
- ・パウエルFRB理事 発言

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) -2.6% (前回 -4.6%)



出所 : Bloomberg

指標結果データ

◀MBA 住宅ローン申請指数▶

	10/27	10/20	10/13	10/6	9/29	前年同期
申請指数	-2.6	-4.6	3.6	-2.1	-0.4	-19.8
購入	-0.8	-6.1	4.2	-0.1	1.0	9.2
借換え	-4.5	-3.0	3.0	-4.2	-1.8	-37.9
固定金利	-3.0	-4.9	4.1	-2.7	0.1	-21.8
変動金利	2.5	0.2	-4.3	7.9	-8.1	22.1

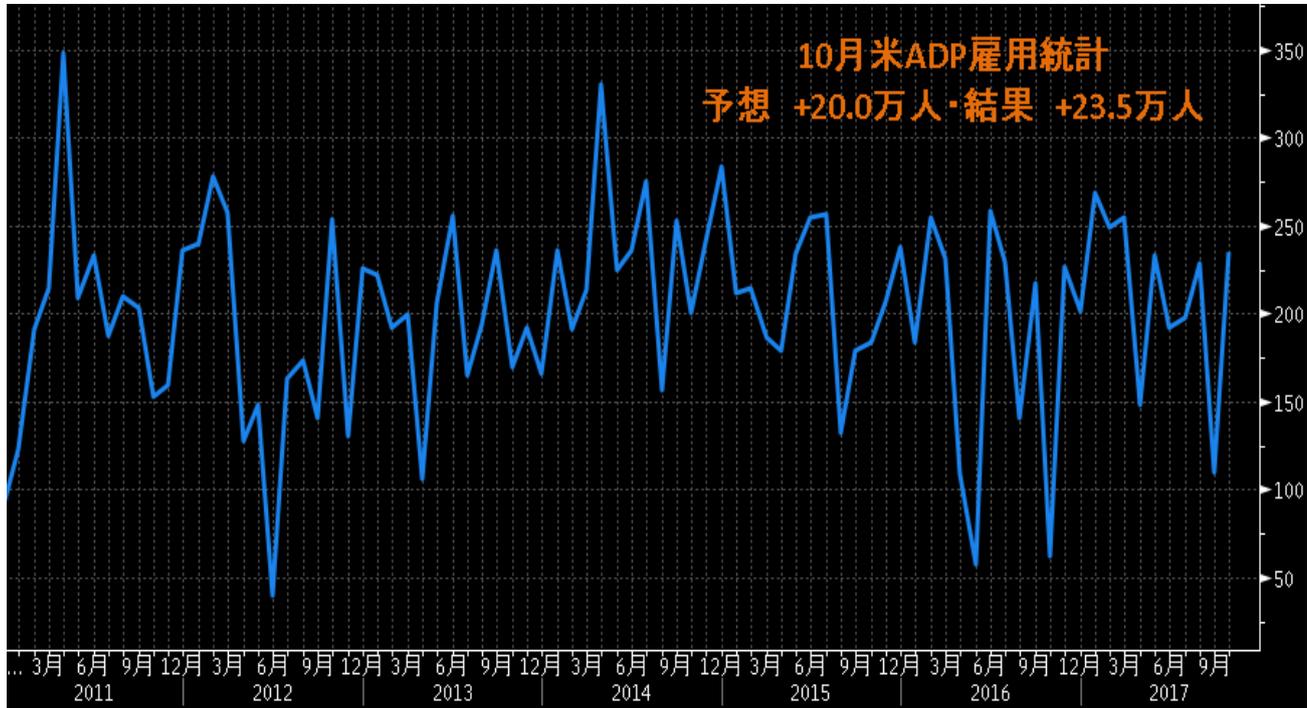
固定金利 30年 ・ 4.22 ・ 4.18 ・ 4.14 ・ 4.16 ・ 4.12

固定金利 15年 ・ 3.52 ・ 3.48 ・ 3.45 ・ 3.44 ・ 3.42

21 : 15

◀ 経済指標の結果 ▶

10月米ADP雇用統計 +23.5万人（予想 +20.0万人・前回 +11.0万人）
 前回発表の+13.5万人から+11.0万人に修正



出所：Bloomberg

指標結果データ

◀ADP雇用統計▶

10月・9月・8月・7月・6月・5月
 ADP雇用者数（前月比）・23.5・11.0・22.8・20.1・19.2・23.3
 （万人）

10月の米ADP雇用統計では、雇用者数の伸びが市場予想を上回る+23.5万人となり、3月以来の高い伸びとなった。大型ハリケーン「ハービー」と「イルマ」襲来の影響から回復したことが示唆された。製造業や建設業を含む財生産部門の雇用は+8.5万人、建設部門は+6.2万人と2006年2月以来の大幅な伸びとなった。サービス業の雇用は+15万人となり、ビジネスサービス部門は+10.9万人と、統計を取り始めた2002年以降で最大の伸びとなった。従業員が500人以上の大企業の雇用者は+9.0万人、50-499人の中堅企業では+6.6万人、49人以下の小企業では+7.9万人となった。

21 : 15

◀ 要人発言 ▶

安倍首相～記者会見

- ・「閣議で新しい政策パッケージ策定を指示する」
- ・「2020年までを生産性革命集中投資期間と位置付ける」
- ・「政策パッケージを来月上旬に取りまとめる」
- ・「閣議で補正予算編成を指示する」
- ・「補正予算を年末に向けて編成する」
- ・「これからも経済最優先、3本の矢を放ち続ける」
- ・「賃上げの勢いを力強いものとしてデフレ脱却を目指す」

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

10月米ISM製造業景況指数 58.7 (予想 59.5・前回 60.8)



出所 : Bloomberg

経済指標データ

◀米ISM製造業景況指数▶

	10月	9月	8月	7月	6月
景況	58.7	60.8	58.8	56.3	57.8
価格	68.5	71.5	62.0	62.0	55.0
生産	61.0	62.2	61.0	60.6	62.4
新規受注	63.4	64.6	60.3	60.4	63.5
受注残	55.0	58.0	57.5	55.0	57.0
入荷遅延	61.4	64.4	57.1	55.4	57.0
在庫	48.0	52.5	55.5	50.0	49.0
雇用	59.8	60.3	59.9	55.2	57.2

10月の米ISM製造業景況指数は、市場予想を下回る58.7と前月から2.1ポイント低下した。ただ、製造業の景気拡大・縮小の判断基準となる50は14カ月連続で上回った。新規受注が63.4(前月64.6)、雇用が59.8(60.3)、生産が61.0(62.2)、仕入れ価格が68.5(71.5)、在庫が48.0(52.5)といずれも前月から低下した。また、10月は18業種中16業種が景況拡大を報告した。

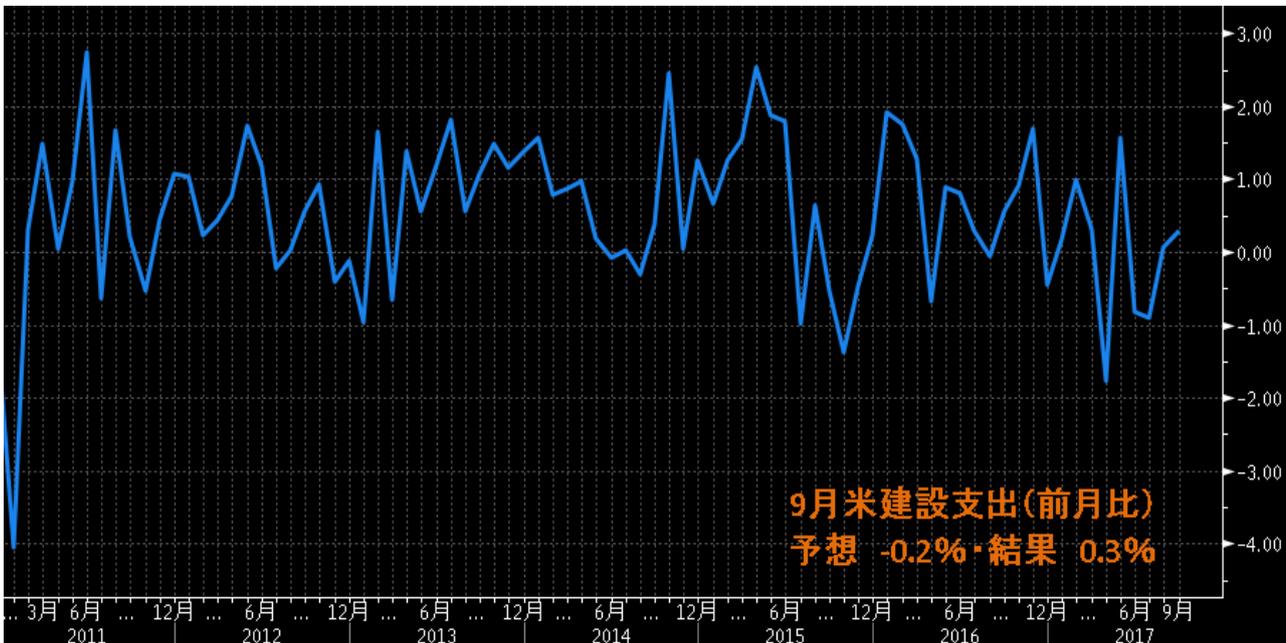


出所 : Net Dania

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

9月米建設支出(前月比) 0.3% (予想 -0.2%・前回 0.1%)
 前回発表の0.5%から0.1%に修正



出所 : Bloomberg

9月米建設支出は、年率換算で前月比+0.3%の1兆2195億4400万ドルとなり、2ヵ月連続のプラスとなった。前年比では+2.0%だった。民間の建設支出は、前月比-0.4%の9427億2900万ドル、前年比では+3.1%だった。住宅建設が前月比横ばいの5154億2200万ドル、前年比では+9.6%。住宅以外では前月比-0.8%の4273億800万ドル、電力や製造業などが減少した。住宅以外の建設の前年比は-3.8%だった。連邦政府など公共部門の建設支出は、前月比+2.6%の2768億1500万ドル、前年比では-1.6%だった。

23 : 30

《EIA 米在庫統計》

原油在庫・・・244 万バレル減少
 ガソリン在庫・・・402 万バレル減少
 留出油在庫・・・32.0 万バレル減少
 クッシングの原油在庫・・・9.0 万バレル増加

10 月米自動車販売

フィアット・クライスラーは-13.0% (予想-12.0%)
 フォードは+6.4% (予想+1.4%)
 GMは-2.2% (予想-1.5%)

トヨタは+1.1% (予想+4.0%)
 日産は+8.4% (予想-5.7%)
 ホンダは+0.9% (予想-2.2%)

1 : 30

《 要人発言 》

トランプ米大統領

- ・「イエレン氏は優秀だと思う」
- ・「(イエレン氏を選出するのかとの質問に) そうは言っていない」
- ・「次期 FRB 議長に誰を指名するか 2 日午後を発表する」
- ・「大いに感心される人材」

《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 指数は、英国の利上げ観測が圧迫要因となり、小幅安となった。一方、独 DAX 指数は、企業の業績拡大期待や日本株の上昇などが好感されて、取引時間中と終値の最高値を更新した。

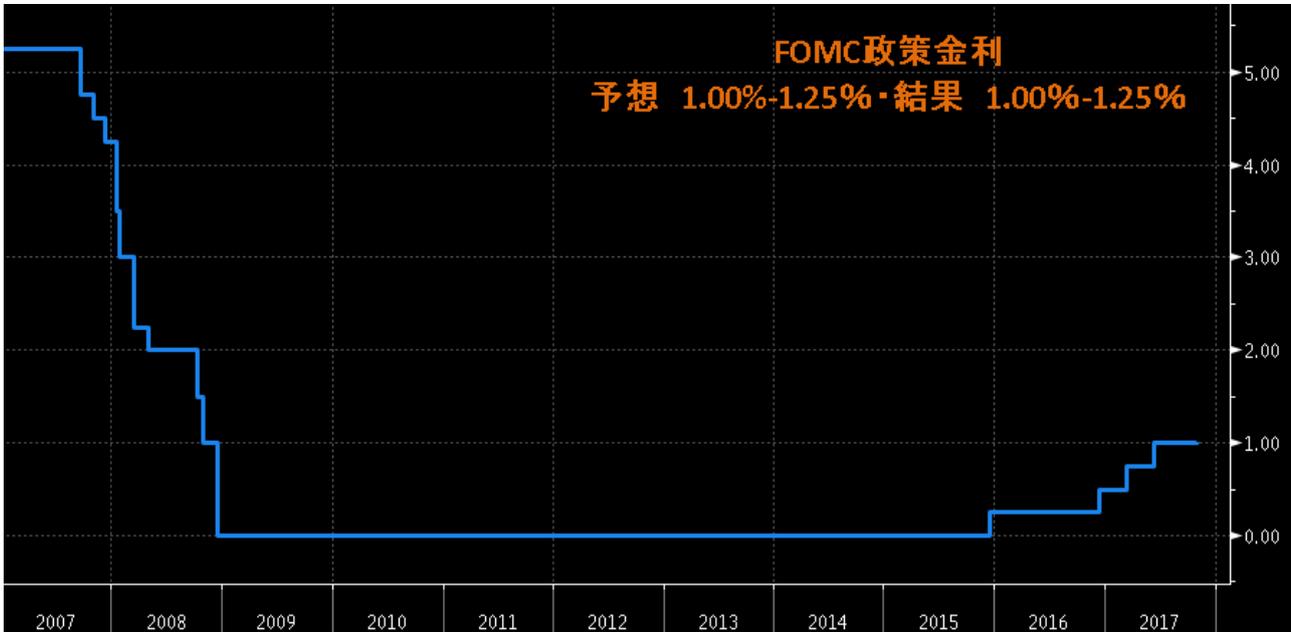


出所 : Bloomberg

3 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

FOMC 政策金利 1.00%-1.25% (予想 1.00%-1.25%・前回 1.00%-1.25%)



出所 : Bloomberg

3 : 00

FOMC 声明

- ・「FF 金利の誘導目標を 1.00%-1.25%で維持」
- ・「経済活動はハリケーンにもかかわらず着実に拡大」
- ・「段階的な利上げ正当化するような経済の展開を想定している」
- ・「食品・エネルギー除くインフレ、引き続き軟調」

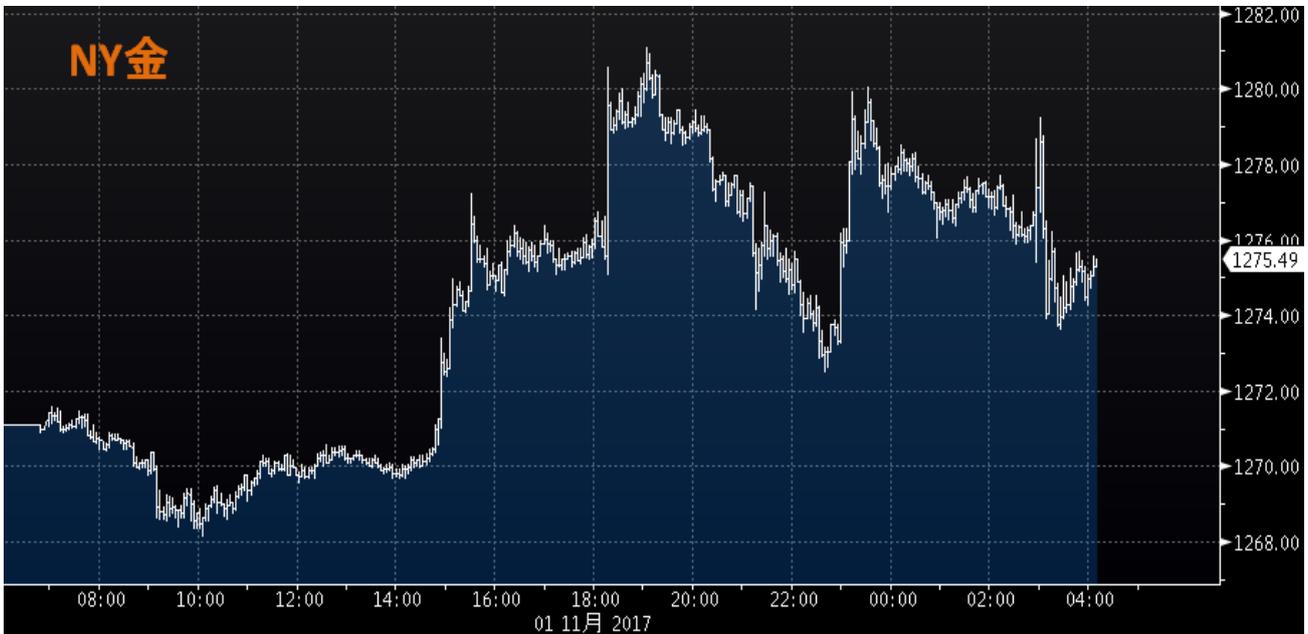


出所 : Net Dania

◀ NY 金市場 ▶

NY 金は、中心限月が前日比 6.80 ドル高の 1 オンス=1277.30 ドルで取引を終了した。

NY 金は、米 FRB の次期議長にパウエル FRB 理事が指名されるとの観測を受けて、堅調な動きとなった。その後、FOMC 声明が市場の想定内の内容だったことから安心感が広がり、時間外取引で一段高となる場面もあった。

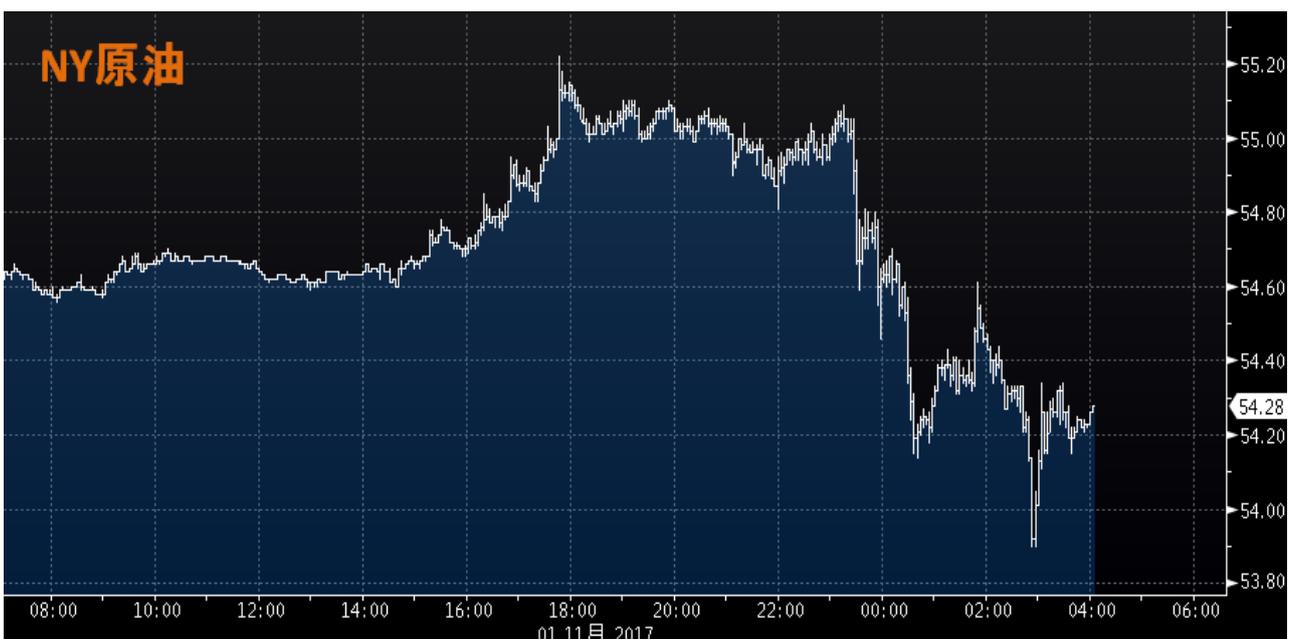


出所：Bloomberg

◀ NY 原油市場 ▶

NY 原油は、中心限月が前日比 0.08 ドル安の 1 バレル=54.30 ドルで取引を終了した。

NY 原油は、OPEC 加盟国と非加盟国による原油の協調減産が延長されるとの期待を背景に、序盤から堅調な動きとなり、一時 1 バレル=55 ドル台まで上昇し、1 月上旬以来約 10 カ月ぶりの高値をつける場面もあった。しかし、米 EIA の原油在庫の減少幅が、米国石油協会の統計より小さかったことが嫌気され、売りが優勢となった。



出所：Bloomberg

《米株式市場》

米株式市場は、10月の民間の雇用関連指標が市場予想を上回ったことを受けて、買い安心感が広がり、序盤から堅調な動きとなった。また、東京や欧州の主要株価が軒並み上昇したことも影響した。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時取引時間中の過去最高値を更新した。ただ、その後は上げ幅を縮小する動きとなり、ナスダックはマイナス圏まで下落した。



出所：Bloomberg

《外国為替市場》

外国為替市場は、米雇用関連の経済指標が堅調な結果となり、ドルが上昇したものの、その後に発表された製造業関連の経済指標が悪化したことから、ドル円・クロス円は下落となった。そして、FOMCの声明を受けて、年内の利上げ期待が高まったとの見方から、再びドル円・クロス円は堅調な動きとなった。



出所：Bloomberg

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。