NYマーケットレポート(2013 年 8 月 1 日)

昨晩の NY 外国為替市場は、序盤に発表された新規失業保険申請件数が 5 年半ぶりの水準に減少したことや、ISM 製造業景況指数が 2 年 1 ヵ月ぶりの高水準となったことを受けて、米金融当局が年内に資産購入のペースを減速させるとの見方が強まり、ドルが主要通貨に対して上昇する動きとなりました。一方、ユーロは、ドラギ ECB 総裁が低金利を維持する方針を示したことを嫌気して売られる場面もありましたが、想定内との受け止め方も多く、下値は限定的となりました。そして、ダウ平均株価が最高値を更新するなど、堅調な株価動向を背景に、投資家のリスク回避の動きも後退し、安全資産の円を売る動きが優勢となり、円は全ての主要通貨に対して下落する動きとなりました。

2013/8/1（木）

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	98.62	98.79	97.66
EUR/JPY	130.53	130.98	129.93
GBP/JPY	149.46	149.63	148.30
AUD/JPY	88.46	88.56	87.23
EUR/USD	1.3237	1.3311	1.3236

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	98.86	98.56
EUR/JPY	130.84	130.41
GBP/JPY	150.33	149.46
AUD/JPY	88.77	88.33
EUR/USD	1.3254	1.3227

*LD高安は東京クローズ～NYオープンまでの高安

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	99.49	99.58	98.61
EUR/JPY	131.45	131.49	130.41
GBP/JPY	150.44	150.76	150.08
AUD/JPY	88.82	88.94	88.16
NZD/JPY	78.47	78.58	77.98
EUR/USD	1.3213	1.3268	1.3194
AUD/USD	0.8928	0.8991	0.8907

米主要株	終値	前日比
米ダウ平均	15628.02	+128.48
S&P500	1706.87	+21.14
NASDAQ	3675.74	+49.37
その他主要株	終値	前日比
トロント総合	12593.96	+107.32
ボルサ指数	41863.76	+1025.88
ボベスパ指数	49140.78	+906.29

8/2 経済指標スケジュール

08:50 【日】7月マネタリーベース
10:30 【豪】2Q生産者物価指数
15:00 【英】7月ネーションワイド住宅価格
16:30 【スイス】7月製造業PMI
17:00 【ノルウェー】7月失業率
17:30 【英】7月建設業PMI
18:00 【欧】6月生産者物価指数
21:30 【米】6月PCEコア・デフレーター
21:30 【米】7月失業率
21:30 【米】7月非農業部門雇用者数
21:30 【米】7月製造業雇用者数
21:30 【米】6月個人所得
21:30 【米】6月個人支出
23:00 【米】6月製造業受注指数

主要会議・講演・その他予定

・セントルイス連銀総裁 講演

欧州主要株	終値	前日比
英FT100	6681.98	+60.92
仏CAC40	4042.73	+50.04
独DAX	8410.73	+134.76
ST欧州600	303.29	+3.71

コモディティー	終値	前日比
NY GOLD	1311.00	-1.40
NY 原油	107.89	+2.86
CMEコーン	487.50	-11.50
CBOT 大豆	1357.75	-16.25

米国債利回り	本　日	前　日
2年債	0.33%	0.31%
3年債	0.64%	0.59%
5年債	1.49%	1.38%
7年債	2.14%	2.00%
10年債	2.70%	2.58%
30年債	3.75%	3.64%

（出所：ブルームバーグ）

NY 市場レポート

欧州市場

20:00

≪ 経済指標の結果 ≫

BOE 政策金利発表　0.5%(予想　0.5%　前回　0.5%)

（出所：ブルームバーグ）

20:45

≪ 経済指標の結果 ≫

ECB 政策金利発表　0.50%（予想　0.50%・前回　0.50%）

（出所：ブルームバーグ）

21:00
ドル/円　98.73　　ユーロ/円　130.65　　ユーロ/ドル　1.3236

21:00
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	6626.14	+5.08	ダウ INDEX FUTURE	15544	+111
仏 CAC40	4017.38	+24.69	S&P500 FUTURE	1692.00	+11.50
独 DAX	8381.58	+105.61	NASDAQ FUTURE	3103.25	+20.25

（出所：ブルームバーグ）

≪米企業決算≫
米エクソンモービル
4-6 月期調整後 1 株利益 1.55 ドル（予想 1.89 ドル）

21：30
≪ 経済指標の結果 ≫
・新規失業保険申請件数　32.6 万件（予想　34.5 万件・前回　34.5 万件）前回発表の 34.3 万件から 34.5 万件に修正
・失業保険継続受給者数　295.1 万人（予想　300.0 万人・前回　300.3 万人）前回発表の 299.7 万人から 300.3 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≫

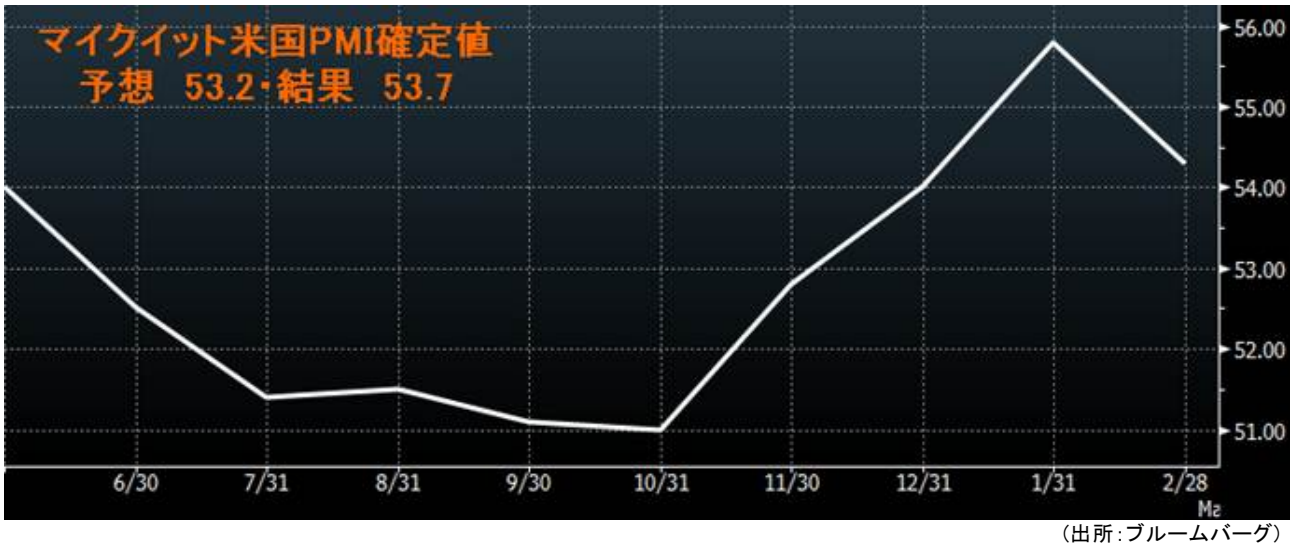
	申請件数	前週比	4週移動平均	受給者数	受給者比率
13/07/27	326,000	−19,000	341,250	＊＊＊＊＊	＊＊＊
13/07/20	345,000	+9,000	345,750	2,951,000	2.3%
13/07/13	336,000	−22,000	346,500	3,003,000	2.3%
13/07/06	358,000	+14,000	351,250	3,116,000	2.4%
13/06/29	344,000	−4,000	345,750	3,027,000	2.3%
13/06/22	348,000	−7,000	346,250	2,953,000	2.3%
13/06/15	355,000	+19,000	348,500	2,987.000	2.3%
13/06/08	336,000	−10,000	345,750	2,966,000	2.3%
13/06/01	346,000	−11,000	352,500	2,991,000	2.3%

受給者数は集計が1週間遅れる

（出所：ネットダニア）

21：350
≪　要人発言　≫
ドラギ ECB 総裁
・「インフレ期待はしっかり抑制されている」
・「長期にわたり金利は現水準かそれを下回る水準に」
・「経済は安定化し、緩慢なペースで回復するだろう」
・「ユーロ圏の経済リスクは引き続き下向き」
・「ユーロ圏のインフレリスクは引き続き「おおむね均衡」
・「フォワードガイダンスを全会一致で確認」
・「流動性は引き続き潤沢にする」
・「短期金融市場の利上げ期待は正当化できない」
・「現在のデータは、ＥＣＢの基本シナリオを確認」
・「ガイダンスを数値基準に結び付ける議論はしなかった」
・「議事録に関する議論は早期の段階」
・「議事録に関する提案は秋に提示する」

21：58
≪ 経済指標の結果 ≫
マイクイット米国 PMI 確定値　53.7（予想　53.2・前回　53.2）



（出所：ブルームバーグ）

22：15
≪　要人発言　≫
ドラギ ECB 総裁
・「目の当たりにする兆候は下期の景気回復見通しに一致」
・「毎回、文言を繰り返すべきかどうかを討議した」
・「『長期にわたり』に正確な期限はない」
・「各政策委員の独立性を脅かすことはしない」
・「どのユーロ参加国にもデフレは見られない」

≪ NY 外国為替市場　序盤 ≫

序盤の外国為替市場は、米失業保険申請件数が前週比で減少し市場予想も下回ったことを受けて、米経済の先行き期待が拡大、円を売ってドルを買う動きが強まった。しかし、週末の米雇用統計を控えて様子見気分も強く、値動きはやや限定的となっている。

22：30

≪ 経済指標の結果 ≫

・7 月シンガポール電子産業指数　50.3（予想　51.0・前回　51.2）

・7 月シンガポール購買部景気指数　51.8（予想　51.3・前回　51.7）

（出所：ブルームバーグ）

22：33

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	15626.10	+126.56
ナスダック	3658.75	+32.33

（出所：ブルームバーグ）

23：00

≪ 経済指標の結果 ≫

7 月 ISM 製造業景況指数　55.4（予想　52.0・前回　50.9）

（出所：ブルームバーグ）

経済指標データ

≪米 ISM 製造業景況指数≫

	7 月	6 月	5 月	4 月	3 月	2 月	1 月
景気	55.4	50.9	49.0	50.7	51.3	54.2	53.1
新規受注	58.3	51.9	48.8	52.3	51.4	57.8	53.3
生産	65.0	53.4	48.6	53.5	52.2	57.6	53.6
雇用	54.4	48.7	50.1	50.2	54.2	52.6	54.0
入荷遅延	52.1	50.0	48.7	50.9	49.4	51.4	53.6
在庫	47.0	50.5	49.0	46.5	49.5	51.5	51.0
価格	49.0	52.5	49.5	50.0	54.5	61.5	56.5
受注残	45.0	46.5	48.0	53.0	51.0	55.0	47.5

（出所：ネットダニア）

23：00
≪ 経済指標の結果 ≫
・6月米建設支出（前月比）　-0.6%（予想　0.4%・前回　1.3%）前回発表の0.5%から1.3%に修正

（出所：ブルームバーグ）

指標結果データ
≪建設支出≫

	6月	5月	4月	3月	2月	1月	前年同月比
総建設支出	-0.5	1.3	1.1	-0.1	0.8	-0.5	3.3
民間部門	-0.4	1.8	0.3	0.4	0.7	-0.3	9.7
住居	0.0	2.8	-0.1	0.4	1.1	11.2	18.1
オフィス	-0.1	-1.5	-5.2	2.2	-1.1	0.9	6.2
商業	-5.6	1.8	0.2	-2.9	0.7	0.6	-3.0
輸送	0.6	-1.6	0.6	-0.4	-1.1	-1.0	-3.0
公共部門	-1.1	0.8	-0.2	-2.9	1.5	0.2	-9.3
教育	-0.4	0.8	-2.5	-5.5	2.9	-2.5	-15.3
道路	-2.8	-0.5	0.4	-2.2	1.6	1.7	-12.4

23：35
≪ NY株式市場　序盤≫
序盤の株式市場は、FOMCの終了後の声明で量的緩和の縮小時期に触れなかったことから、早期縮小観測が後退し、投資家に安心感が広がり、主要株価は堅調な動きとなった。また、米雇用や製造業関連の経済指標が堅調だっ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151ドル高まで上昇し、取引時間中の史上最高値を更新した。

≪ 経済指標のポイント ≫

（1）ECB 理事会は、主要政策金利を過去最低の 0.50%で 据え置くことを決めた。ユーロ圏の 6 月の失業者数が 2011 年 4 月以来 2 年 2 ヵ月ぶりに減少に転じるなど、ユーロ圏経済に回復の兆候が見られることから追加の措置は控え、様子見を続けるとみられる。また、中銀預金金利を 0.0%、限界貸出金利を 1.0%にそれぞれ据え置いた。

（2）英中銀は、MPC（金融政策委員会）で政策金利であるレポ金利を過去最低の 0.50%に据え置いた。据え置きは 4 年 5 ヵ月連続となった。また、資産買い取りプログラムの規模を 3750 億ポンド（約 56 兆 4000 億円）で維持することを決めた。MPC は今会合で、最新の経済見通しを基に金融政策を決定。先月就任したカーニー総裁は来週、四半期物価報告の発表に合わせて記者会見しフォワードガイダンスに関する MPC の所見を公表する。

（3）米失業保険申請件数は,前週比-1.9 万件の 32.6 万件と、2008 年 1 月 19 日までの週以来、約 5 年半ぶりの低い水準となった。申請件数の 4 週移動平均は、前週比-4500 人の 34 万 1250 人で、5 月 18 日までの週以来の低い水準となった。また、集計が 1 週遅れる失業保険受給者総数は、前週比-5.2 万人の 295.1 万人となり、5 月 11 日までの週以来の低い水準となった。受給者総数の 4 週移動平均は、前週比-500 人の 302.6 万人で、7 月 6 日までの週以来の低水準となった。受給者比率は前週から横ばいの 2.3%だった。

（4）6 月の米建設支出は、年率換算で前月比-0.6%の 8839 億 4400 万ドルと 3 ヵ月ぶりにマイナスに転じ、 1 月以来 5 ヵ月ぶりの大幅な落ち込みとなった。前年同月比は+3.3%となった。民間部門は住宅建設に勢いが欠けるとともに住宅以外の施設建設も低調だったためマイナスとなった一方、公共部門は州・地方政府と連邦政府がマイナスとなり、全体を引き下げた。

①民間の建設支出は、前月比-0.4%の 6228 億 3500 万ドル。前年同月比は+9.7%。民間の内訳は住宅建設が前月から横ばいで、前年同月比+18.1%。住宅以外の施設建設は前月比-0.9%、前年同月比は+1.4%。商業、教育、宗教の関連支出のマイナスが目立った。

②連邦政府などの公共部門の建設支出は、前月比-1.1%の 2611 億 900 万ドルと金額ベースで 2006 年 11 月以来 6 年 7 ヵ月ぶりの低い水準にとどまった。州・地方政府が前月比-1.1%、連邦政府が-1.5%となった。

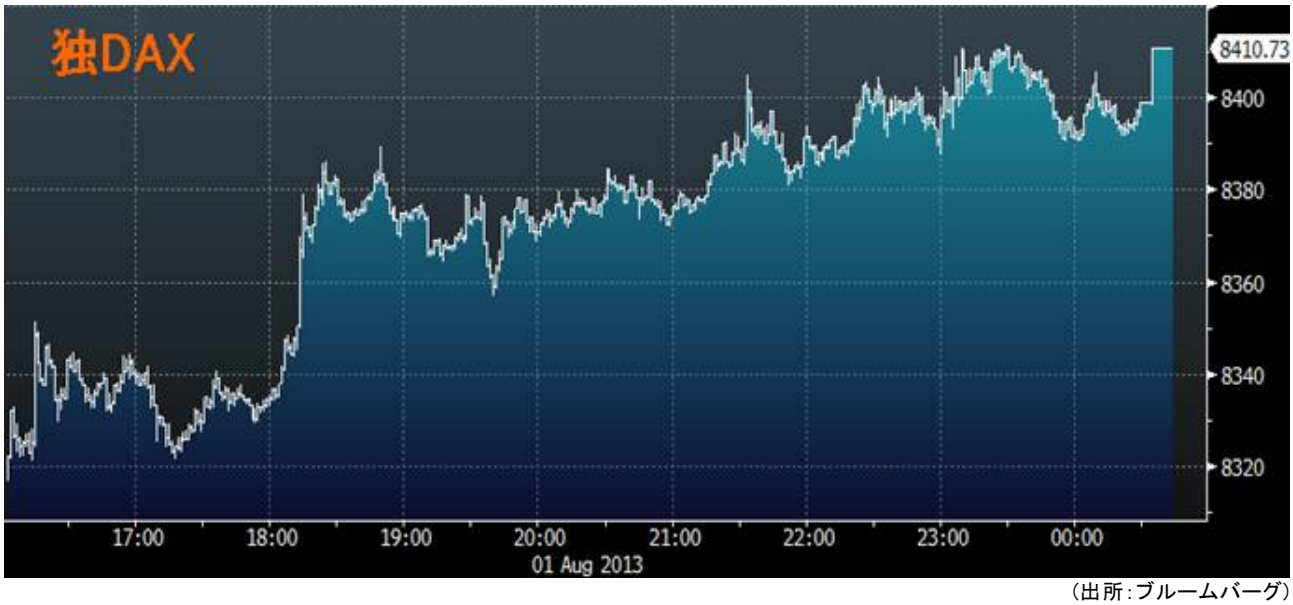
（5）7 月の ISM 製造業総合景況指数は 55.4 と前月から 4.5 ポイント上昇し、2011 年 6 月以来、2 年 1 ヵ月ぶりの高水準となった。製造業の景気拡大・縮小の分岐点となる 50 を 2 ヵ月連続で上回った。新規受注が 58.3（前月 51.9）、生産が 65.0（53.4）、 雇用が 54.4（48.7）。一方、仕入れ価格は 49.0（52.5）、在庫は 47.0（50.5）と低下した。7 月は 18 業種中 13 業種が業況拡大を報告、前月の 12 業種から増えた。

欧州主要株	終値	前日比
英 FT100	6681.98	+60.92
仏 CAC40	4042.73	+50.04
独 DAX	8410.73	+134.76
ストック欧州 600 指数	303.29	+3.71
ユーロファースト 300 指数	1221.17	+13.00
スペイン IBEX35 指数	8540.20	+106.80
イタリア FTSE MIB 指数	16818.97	+336.62
南ア アフリカ全株指数	41909.39	+616.55

（出所：ブルームバーグ）

≪欧州株式市場≫

欧州株式市場は、欧州や米国などの景況指標が好調だったことや、欧州企業の業績改善への期待を背景に主要株価は堅調な動きとなった。また、ECB が金融緩和を長期化する方針を示したことも支援材料となった。



（出所：ブルームバーグ）

1:00

米主要株価・中盤

ダウ 15621.95（+122.41）、 S&P500 1702.96（+17.23）、 ナスダック 3664.47（+38.10）

≪ NY 債券市場 ・午前≫

午前の債券市場は、米失業保険申請件数や、ISM 製造業景況指数が市場予想より良い内容だったことを受けて、米景気の回復ペースが加速しているとの期待が広がり、安全資産とされる米国債を売る動きが膨らんだ。

午前の利回りは、30 年債が 3.72%（前日 3.65%）、10 年債が 2.67%（2.59%）、7 年債が 2.10%（2.01%）、5 年債が 1.46%（1.39%）、3 年債が 0.63%（0.59%）、2 年債が 0.33%（0.31%）。

3:40
NY 金は、中心限月が前日比 1.40 ドル安の 1 オンス＝1311.00 ドルで取引を終了した。

4:10
NY 原油は、中心限月が前日比 2.86 ドル高の 1 バレル＝107.89 ドルで取引を終了した。

主要商品	終　値	前日比
NY GOLD	1311.00	-1.40
NY　原油	107.89	+2.86

（出所：ブルームバーグ）

≪ NY 金市場 ≫
NY金は、雇用や製造業関連の米経済指標の改善を受けて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先行した。ただ、前日の FOMC で現行の量的緩和の維持が決まったことが相場の下支え要因となり下げ幅は限定的だった。

（出所：ブルームバーグ）

≪ NY 原油市場 ≫
NY原油は、中国や欧米の製造業関連の景況指標がいずれも市場予想を上回ったことから、世界景気の回復ペースが加速しエネルギー需要が伸びるとの期待感から買いが先行した。また、リビアの石油輸出が治安部隊員らのデモによる積み出し港閉鎖で大幅に減少していることも支援材料となった。終値ベースでは、7 月 19 日以来、約 2 週間ぶりの高値水準となった。

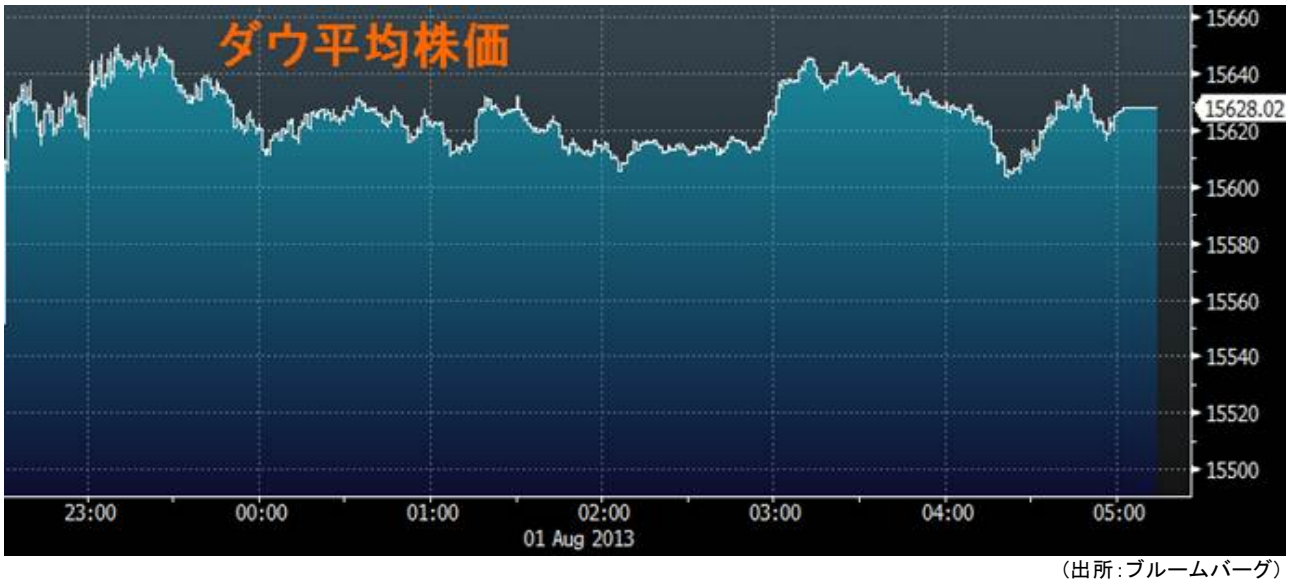
（出所：ブルームバーグ）

米主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	15628.02	+128.48	15650.69	15503.85
S&P500 種	1706.87	+21.14	1707.85	1689.42
ナスダック	3675.74	+49.37	3678.50	3653.74

（出所：ブルームバーグ）

≪米株式市場≫

米株式市場は、FOMC の終了後の声明で量的緩和の縮小時期に触れなかったことから、早期縮小観測が後退し、投資家に安心感が広がり、主要株価は堅調な動きとなった。また、米雇用や製造業関連の経済指標が堅調だっ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 151ドル高まで上昇し、取引時間中の史上最高値を更新した。ただ、その後は高値圏でのもみ合いの展開が続いた。



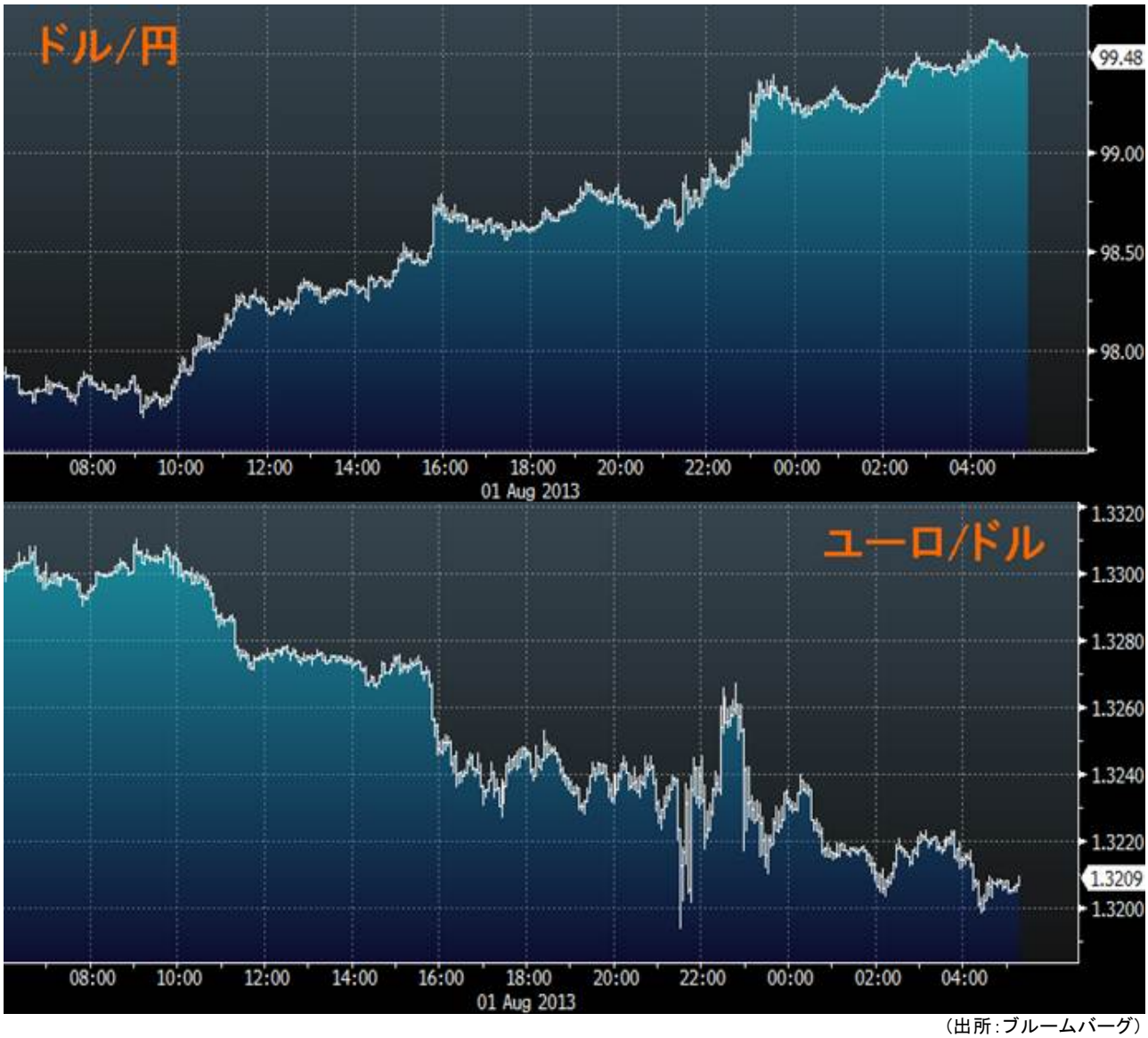
（出所：ブルームバーグ）

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	99.49	99.58	98.61
EUR/JPY	131.45	131.49	130.41
GBP/JPY	150.44	150.76	150.08
AUD/JPY	88.82	88.94	88.16
NZD/JPY	78.47	78.58	77.98
EUR/USD	1.3213	1.3268	1.3194
AUD/USD	0.8928	0.8991	0.8907

（出所：ブルームバーグ）

≪外国為替市場≫

外国為替市場は、雇用関連と製造業関連の米経済指標が堅調な結果となったことから、ドルが主要通貨に対して上昇する動きとなった。また、ダウ平均株価が高値を更新する動きとなったことから、リスク回避の動きが和らぎ、安全資産の円が大半の主要通貨に対して売られる動きとなった。



（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、 複写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。