

NY マーケットレポート (2014 年 7 月 14 日)

外 NY 市場では、米国の主要な経済指標の発表がなく、取引材料に乏しいものの、欧米の株価が堅調な動きとなったことを受けて、ドル円・クロス円は堅調な動きとなった。しかし日銀の政策決定会合の結果発表や、イエレン FRB 議長の議会証言を控えて様子見ムードも強く、やや上値は限定的となった。ユーロは、ドラギ ECB 総裁が、通貨高が回復の持続性を脅かすと警告し、必要なら一段の行動をとる準備ができていると発言したことを受けて、主要通貨に対してやや軟調な動きとなる場面もあった。

2014/ 7/14 (月)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	101.48	101.54	101.33
EUR/JPY	138.37	138.41	137.82
GBP/JPY	173.78	173.88	173.46
AUD/JPY	95.31	95.39	95.07
EUR/USD	1.3636	1.3641	1.3598

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	101.52	101.46
EUR/JPY	138.40	138.22
GBP/JPY	174.02	173.59
AUD/JPY	95.40	95.27
EUR/USD	1.3637	1.3620

*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	15296.82	+132.78
ハンセン指数	23346.67	+113.22
上海総合	2066.65	+19.69
韓国総合指数	1993.88	+5.14
豪ASX200	5511.40	+24.61
インドSENSEX指数	25006.98	-17.37
シンガポールST指数	3290.98	-2.75

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6746.14	+55.97
仏CAC40	4650.04	+33.54
独DAX	9783.01	+116.67
ST欧州600	339.79	+2.88
西IBEX35指数	1606.30	+67.50
伊FTSE MIB指数	20697.54	+82.68
南ア 全株指数	51540.88	+379.55

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	101.55	101.63	101.47
EUR/JPY	138.29	138.45	138.25
GBP/JPY	173.49	173.69	173.36
AUD/JPY	95.37	95.44	95.35
NZD/JPY	89.38	89.53	89.35
EUR/USD	1.3620	1.3632	1.3608
AUD/USD	0.9392	0.9404	0.9387

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17055.42	+111.61
S&P500	1977.10	+9.53
NASDAQ	4440.42	+24.93
その他主要株	終値	前日比
カナ トロント総合	15171.23	+45.73
ブラ ボルサ指数	43967.44	+485.61
メキシコ ボバスバ指数	55743.98	+958.05

7/15 経済指標スケジュール

08:01	【英】6月BRC小売売上高
10:30	【豪】7月豪中銀議事録
10:30	【豪】6月新車販売台数
13:00	【日】6月首都圏新規マンション発売
14:00	【シンガポール】5月小売売上高
15:00	【日】6月工作機械受注
16:00	【トルコ】4月失業率
16:15	【スイス】6月生産者輸入価格
17:30	【英】6月生産者物価指数
17:30	【英】6月小売物価指数
17:30	【英】6月生産者出荷価格
17:30	【英】6月生産者仕入価格
17:30	【英】6月消費者物価指数
18:00	【欧】【独】7月ZEW景況感調査
21:00	【ポーランド】6月消費者物価指数
21:30	【米】6月小売売上高
21:30	【米】7月ニューヨーク連銀製造業景気指数
21:30	【米】6月輸入物価指数
22:00	【カナダ】6月中古住宅販売件数
23:00	【米】5月企業在庫

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1306.70	-30.70
NY 原油	100.91	+0.08
CMEコーン	388.25	+3.50
CBOT 大豆	1086.25	+11.25

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.46%	0.45%
3年債	0.95%	0.92%
5年債	1.67%	1.64%
7年債	2.16%	2.13%
10年債	2.55%	2.52%
30年債	3.37%	3.34%

7/15 主要会議・講演・その他予定

・日銀総裁 定例会見

(出所: SBILM)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 101.48 ユーロ/円 138.28 ユーロ/ドル 1.3628

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	6735.72	+45.55	ダウ INDEX FUTURE	16944	+63
仏 CAC40	4346.56	+30.06	S&P500 FUTURE	1969.40	+7.00
独 DAX	9749.03	+82.69	NASDAQ FUTURE	3916.25	+18.75

(出所:SBILM)

21:00

《米企業決算》

米シティグループ

第2四半期 調整後1株利益 1.24ドル (予想 1.05ドル)

21:00

《経済指標の結果》

5月ポーランド経常収支 2.8億EUR (予想 4.48億EUR・前回 9.41億EUR)

前回発表の10.28億EURから9.41億EURに修正

5月ポーランド貿易収支 1.75億EUR (予想 4.43億EUR・前回 7.33億EUR)

前回発表の8.56億EURから7.33億EURに修正



(出所:ブルームバーグ)



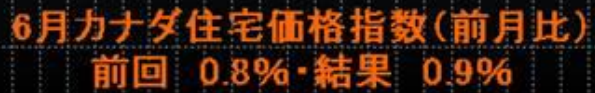
(出所:ブルームバーグ)

22 : 00

《 経済指標の結果 》

6月力ナタ住宅価格指数（前月比） 0.9%（前回 0.8%）

6月力ナタ住宅価格指数（前年比） 4.4%（前回 4.6%）



(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	17045.24	+101.43
ナスダック	4440.64	+25.15

(出所:SBILM)

23 : 35

≪ NY 株式市場 序盤 ≫

序盤の株式市場は、金融大手の 4-6 月期決算の内容が市場予想を上回ったことから、今後も堅調な決算発表が相次ぐとの期待感から主要株価は堅調な動きとなった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前週末比 141 ドル高まで上昇し、取引時間中の最高値を更新した。

≪ 欧州のポイント ≫

①5 月のユーロ圏鉱工業生産は、前月比-1.1%、前年比は+0.5%となり、ユーロ圏の景気回復の勢いが依然として弱いことが示される結果となった。前月比では中間財の生産が-2.4%、非耐久財が-2.2%となった。一方、エネルギーの生産は+3.0%と、唯一増加となった。国別では、ドイツの生産が前月比-1.4%と、2013 年 5 月以来の大きな減少率を記録。フランスは-1.3%と 2013 年 6 月以来の大幅な減少率で、イタリアは-1.2%と 2012 年 11 月以来の大きな減少率となった。

②ポルトガルの国内最大行バンコ・エスピリト・サント (BES) の筆頭株主であるエスピリト・サント・フィナンシャル・グループは、BES 株式 4.99% を売却したことを明らかにした。5 月の資本増強時の借り入れの返済のためという。これにより、エスピリト・サント・フィナンシャル・グループの BES への出資比率は 20.1% に低下した。BES の取締役会は、新経営陣を発表した。最高経営責任者には、著名エコノミスト、ビートル・ベント氏が指名された。最高財務責任者には、ポルトガル政府の公債管理機関 IGCP のジョアオ・モレイラ・ラト氏が就く予定。7 月 31 日の株主総会で承認される必要があるという。エスピリト・サント家を代表するリカルド・エスピリト・サント・サルガド CEO は先月退任を表明していた。ポルトガル中央銀行は、BES の財務問題に対する投資家不安を払拭するため、新経営陣の早期就任を求めている。

③IMF は、ユーロ圏経済に関する報告書で、一段の衝撃が及べば回復の腰を折りがねず、改善傾向にある市場の地合いを損なうとともに、デフレに陥る恐れがあると指摘した。報告書は、ユーロ圏経済の回復は依然脆弱とし、「短期的に政策余地が限られている中で、ユーロ圏経済に内外から一段のネガティブな衝撃が及べば、金融市場の地合いを悪化させるとともに、回復を停滞させ、低インフレ、もしくはデフレに陥る可能性がある」との見解を示した。「総じて中立的な財政スタンスは適切」としながらも、成長が下振れした場合でも、追加の緊縮措置は「自己破滅的」として、控えるよう提言した。IMF は、別の報告書で、ECB が量的緩和策に踏み切る場合には、主要国だけでなく、ユーロ圏諸国全体が恩恵を受けるよう確実にする必要があると指摘した。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6746.14	+55.97
仏 CAC40	4650.04	+33.54
独 DAX	9783.01	+116.67
ストック欧州 600 指数	339.79	+2.88
ユーロファースト 300 指数	1363.49	+11.38
スペイン IBEX35 指数	10606.30	+67.50
イタリア FTSE MIB 指数	20697.54	+82.68
南ア アフリカ全株指数	51540.88	+379.55

(出所:SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、欧州企業の業績に先行き期待が広がったことや、前週売られて値頃感が出た銘柄を中心に買いが入ったことから、主要株価は堅調な動きとなった。また、ポルトガルの銀行問題が後退するとの見方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 17076.30 (+132.49)、S&P500 1979.24 (+11.67) ナスダック 4445.04 (+29.54)

0 : 05

FRB は、ニューヨーク連邦準備銀行を通じた公開市場操作により、11.3 億ドルの米長期国債の買い取りを実施した。

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、前週の大暴落の反動で、一旦利益を確定するための売りが先行した。欧米の株価が値上がりし投資家のリスク回避志向が後退したことや、米 FRB のイエレン議長の議会証言を 15 日に控えて警戒感が広がったことも、相場の圧迫要因となった。

午前の利回りは、30 年債が 3.35% (前週末 3.34%)、10 年債が 2.54% (2.52%)、7 年債が 2.16% (2.13%)、5 年債が 1.67% (1.64%)、3 年債が 0.95% (0.92%)、2 年債が 0.46% (0.45%)。

《 欧州債券市場 》

欧州債市場は、ポルトガルが国内の銀行問題を封じ込めることが可能との見方が広がったことからポルトガル 10 年債が続伸、2 営業日の上げ幅はここ 1 カ月で最大となった。また、ギリシャ国債も 2 営業日連続で上昇となった。ポルトガル 10 年債利回りは、前週末比 6bp 低下の 3.81%、2 営業日の下げ幅は 18bp と、先月 10 日以来の大幅低下となった。先週は 28bp 上昇と、昨年 9 月以来の大きな上げとなっていた。一方、ギリシャ 10 年債利回りは 3bp 低下の 6.23%。スペイン 10 年債利回りは 2.78%、ドイツ 10 年債利回りは 1.21%となった。

3 : 30

NY 金は、中心限月が前日比 30.70 ドル安の 1 オンス=1306.70 ドルで取引を終了した。

4 : 15

NY 原油は、中心限月が前日比 0.08 ドル高の 1 バレル=100.91 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1306.70	-30.70
NY 原油	100.91	+0.08

(出所:SBILM)

《 NY 金市場 》

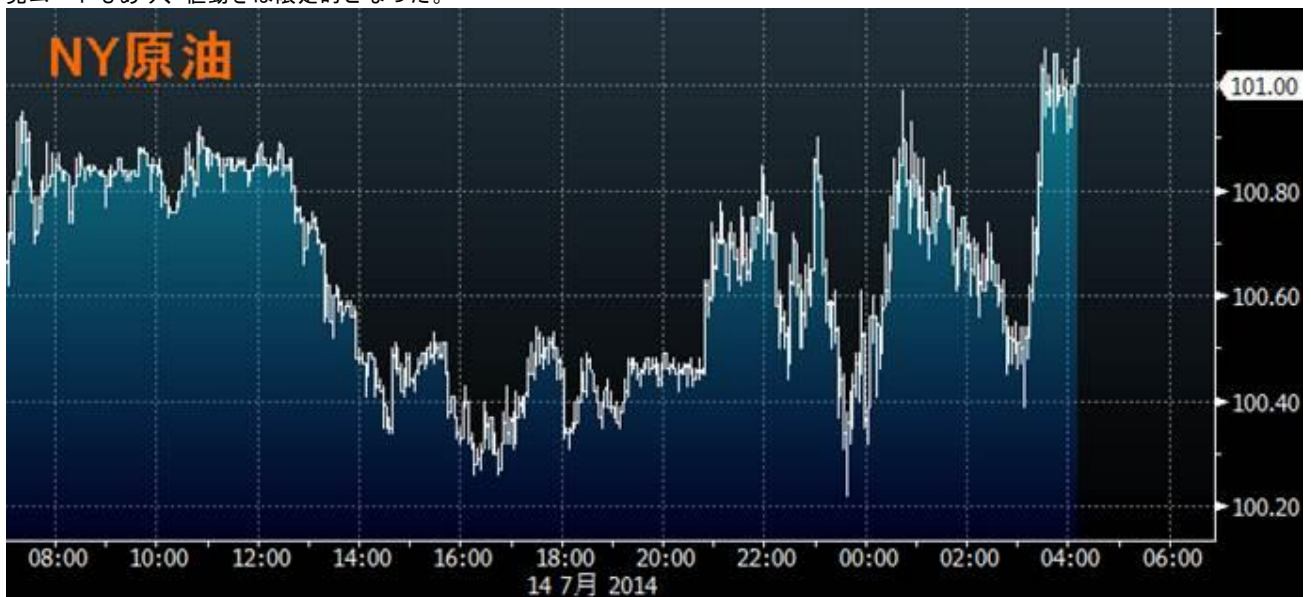
NY 金は、ポルトガルの銀行大手の財務問題を背景とした欧州の金融不安が後退したことや、欧米の株価が上昇したことを背景に、利益確定などの売りが優勢となった。終値ベースでは、6 月中旬以来、約 1 ヶ月ぶりの安値水準となった。



(出所:ブルームバーグ)

《 NY 原油市場 》

NY 原油は、リビアの主要空港周辺で武装勢力同士が衝突したとの報道を受けて、原油供給に再び悪影響を与えるとの懸念を背景に、買いが優勢となった。ただ、イラク情勢や、イラン核問題をめぐる欧米など 6 ヶ国との協議の行方を見極めたいとの様子見ムードもあり、値動きは限定的となった。



(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	17055.42	+111.61	17088.43	16950.93
S&P500 種	1977.10	+9.53	1979.85	1969.86
ナスダック	4440.42	+24.93	4451.60	4432.95

(出所:SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、金融大手の 4-6 月期決算の内容が市場予想を上回ったことから、今後も堅調な決算発表が相次ぐとの期待感から主要株価は堅調な動きとなった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前週末比 141 ドル高まで上昇し、取引時間中の最高値を更新する場面もあった。



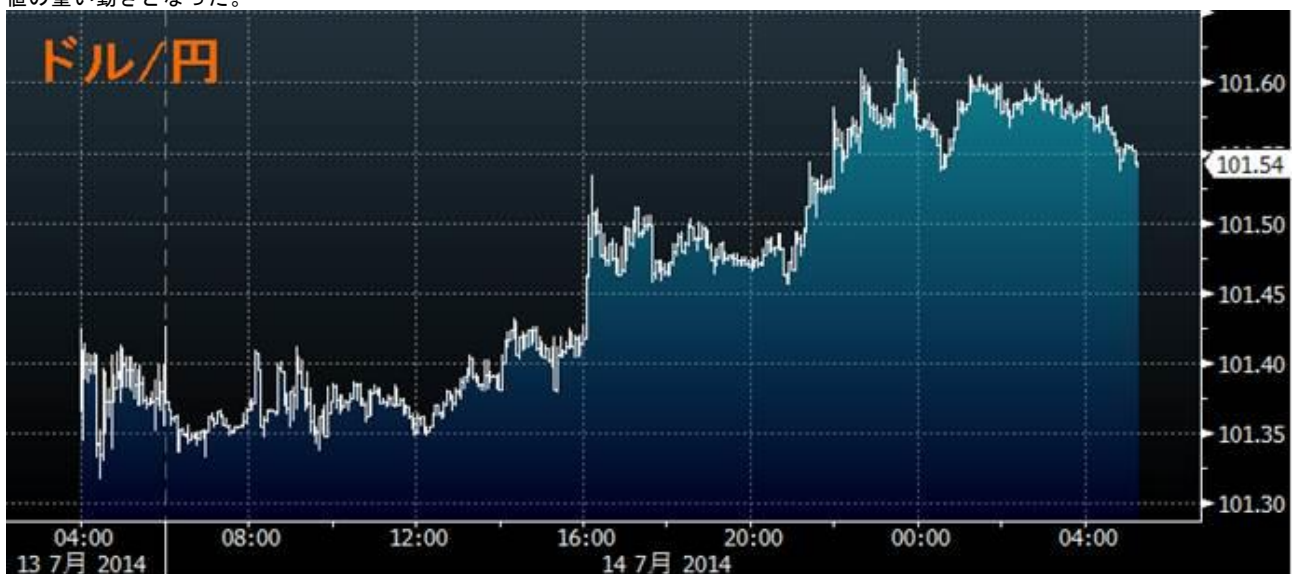
(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	101.55	101.63	101.47
EUR/JPY	138.29	138.45	138.25
GBP/JPY	173.49	173.69	173.36
AUD/JPY	95.37	95.44	95.35
NZD/JPY	89.38	89.53	89.35
EUR/USD	1.3620	1.3632	1.3608
AUD/USD	0.9392	0.9404	0.9387

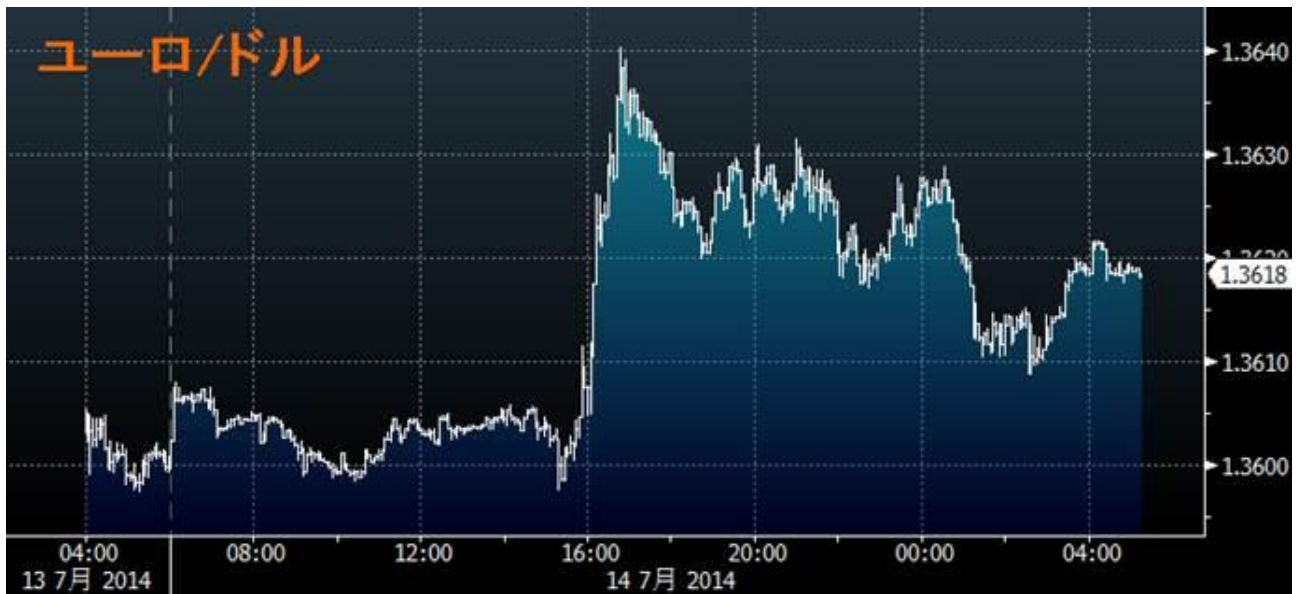
(出所:SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、米国の主要な経済指標の発表がなく、取引材料に乏しい中、欧米の株価が堅調な動きとなったことから、円を売る動きが優勢となった。ただ、イエレン FRB 議長の議会証言などを控えて様子見ムードも強まり、ドル円・クロス円はやや上値の重い動きとなった。



(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。