

NY マーケットレポート (2014 年 7 月 23 日)

NY 市場では、米国の主要な経済指標の発表がなく、取引材料に乏しい中、序盤のドル円・クロス円は小動きの展開となった。その後は、序盤下落した株価が下げ幅を縮小する動きとなったことから、値を戻す動きも見られたが、上値は限定的となった。ユーロは、ロシアに対する制裁強化がユーロ圏経済に打撃を与えるとの見方を背景に、主要通貨に対して上値の重い動きとなり、特に対ドルでは、2013 年 11 月 21 日以来の安値を付ける動きとなった。また、NZ ドルは、中銀が 0.25% の利上げを決定したものの、現状の為替水準は正当化できないとしたことや、利上げ終了を示唆する声明を受けて、主要通貨に対して大きく下落する動きとなった。

2014/ 7/23 (水)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	101.38	101.55	101.35
EUR/JPY	136.53	136.75	136.41
GBP/JPY	173.12	173.30	172.99
AUD/JPY	95.77	95.79	95.22
EUR/USD	1.3457	1.3471	1.3455

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	101.45	101.32
EUR/JPY	136.65	136.41
GBP/JPY	173.34	172.65
AUD/JPY	95.85	95.73
EUR/USD	1.3475	1.3456

*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	15328.56	-14.72
ハンセン指数	23971.87	+189.76
上海総合	2078.49	+3.01
韓国総合指数	2028.32	-0.61
豪ASX200	5576.75	+33.45
インドSENSEX指数	26147.33	+121.53
シンガポールST指数	15344.10	+63.42

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6798.15	+2.81
仏CAC40	4376.32	+6.80
独DAX	9753.56	+19.23
ST欧州600	342.86	+0.42
西IBEX35指数	10659.10	+10.20
伊FTSE MIB指数	20831.26	-42.24
南ア 全株指数	51910.92	-20.41

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	101.51	101.55	101.37
EUR/JPY	136.64	136.76	136.50
GBP/JPY	172.95	173.11	172.62
AUD/JPY	95.97	96.02	95.75
NZD/JPY	88.27	88.29	88.00
EUR/USD	1.3463	1.3474	1.3456
AUD/USD	0.9454	0.9458	0.9436

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17086.63	-26.91
S&P500	1987.01	+3.48
NASDAQ	4473.70	+17.68
その他主要株	終値	前日比
カナダトロント総合	15394.38	+79.25
ブラジルボルサ指数	44199.01	-58.08
ボネバ指数	57419.96	-563.36

7/24 経済指標スケジュール

08:50 【日】6月貿易収支
10:45 【中】7月HSBC製造業PMI
16:00 ~ 17:00
【仏】【独】【欧】7月製造業PMI・7月製造業PMI
16:30 【スウェーデン】6月失業率
16:30 【スウェーデン】6月生産者物価指数
17:30 【英】6月小売売上高指数
17:30 【香港】6月貿易収支
21:30 【米】新規失業保険申請件数
21:30 【米】失業保険継続受給者数
23:00 【米】6月新築住宅販売件数
23:00 【米】7月カンザスシティ連銀製造業活動指数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1304.70	-1.60
NY 原油	103.12	+0.73
CMEコーン	370.75	+2.50
CBOT 大豆	1076.50	+18.75

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.47%	0.48%
3年債	0.94%	0.96%
5年債	1.65%	1.65%
7年債	2.11%	2.11%
10年債	2.46%	2.46%
30年債	3.26%	3.25%

7/24 主要会議・講演・その他予定

・米10年TPIS債入札

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 101.41 ユーロ/円 136.57 ユーロ/ドル 1.3470

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	6808.35	+13.01	ダウ INDEX FUTURE	17048	+15
仏 CAC40	4387.02	+17.50	S&P500 FUTURE	1977.80	+2.90
独 DAX	9784.12	+49.12	NASDAQ FUTURE	3964.25	+13.75

(出所: SBILM)

《企業決算》

米ボーイング

第2四半期 1株利益 2.42ドル (予想 1.98ドル)

米ペプシコ

第2四半期の1株利益は 1.32ドル (予想 1.23ドル)

米ダウ・ケミカル

第2四半期 調整後の1株利益 0.74ドル (予想 0.71ドル)

21:30

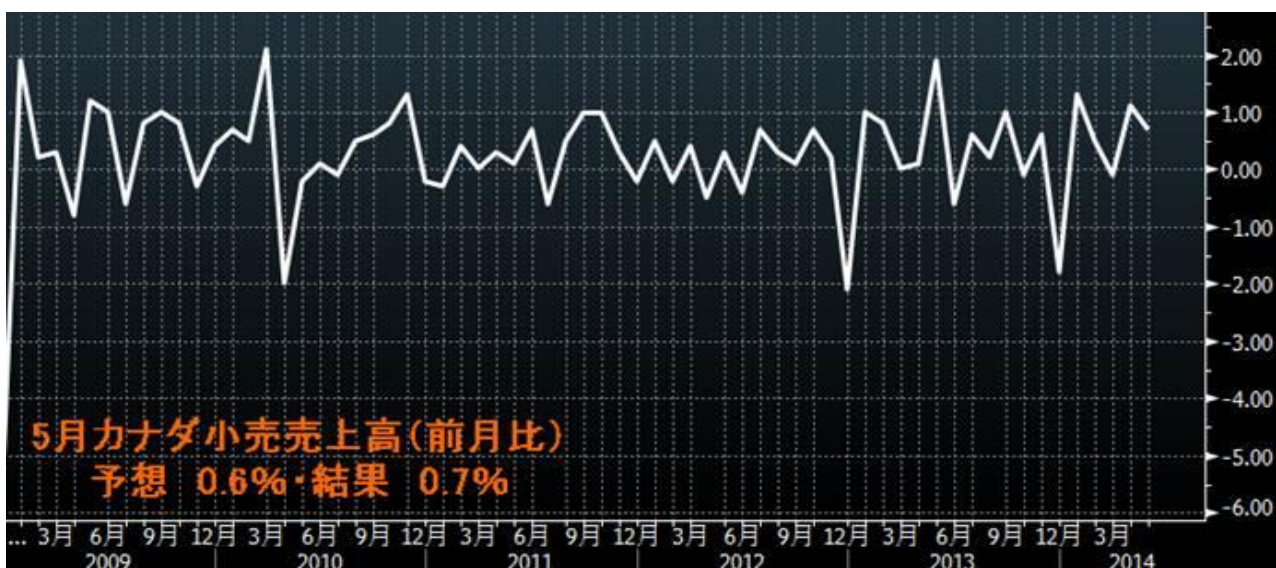
《経済指標の結果》

5月カナダ小売売上高 (前月比) 0.7% (予想 0.6%・前回 1.3%)

前回発表の 1.1% から 1.3% に修正

5月カナダ小売売上高 [除自動車] 0.1% (予想 0.3%・前回 0.8%)

前回発表の 0.7% から 0.8% に修正



(出所: ブルームバーグ)

《 NY 外国為替市場 序盤 》

序盤の外国為替市場は、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、ドル円・クロス円は序盤から方向感に欠ける展開が続いている。

22 : 37

米主要株価

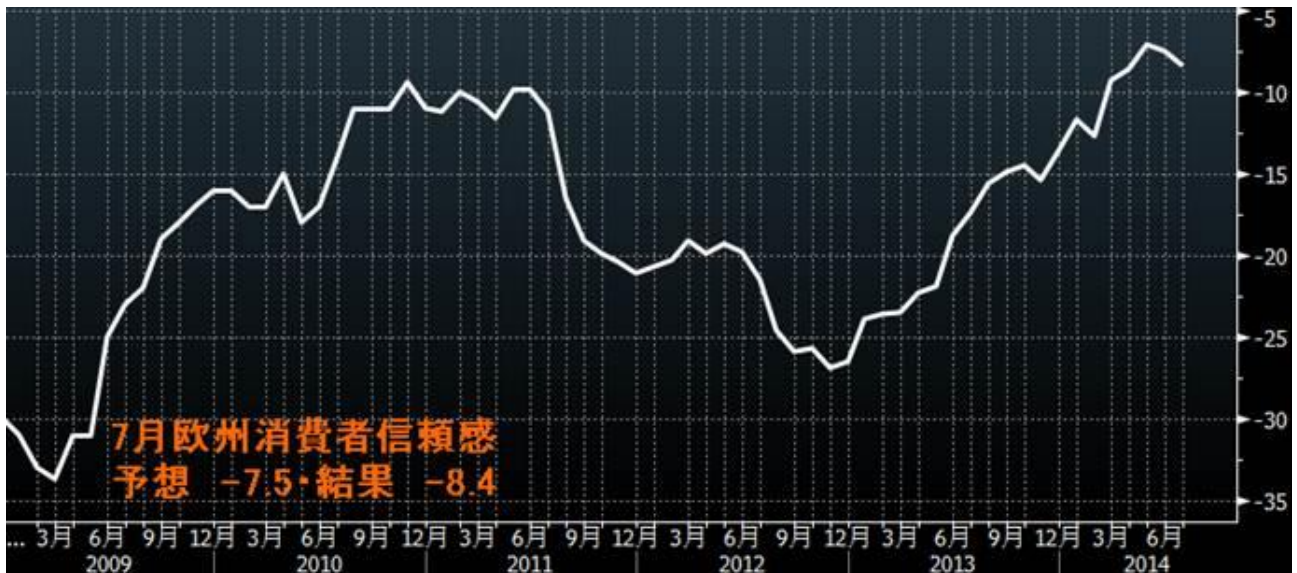
米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17080.59	-32.95
ナスダック	4465.21	+9.19

(出所:SBILM)

23 : 00

《 経済指標の結果 》

7月欧州消費者信頼感 -8.4 (予想 -7.5・前回 -7.5)



(出所:ブルームバーグ)

指標結果データ

《ユーロ圏消費者信頼感指数》

7月・・6月・・5月・・4月・・3月・・2月

ユーロ圏消費者信頼感指数・・-8.4・・-7.5・・-7.1・・-8.6・・-9.3・・-12.7

《 経済指標のポイント 》

(1) MBA (全米抵当貸付銀行協会) の住宅ローン申請指数は、前週比+2.4%となった。借り換え申請が増加したことが要因となった。構成指数の借り換え指数は+4.1%、購入指数は+0.3%となり、申請全体に占める借り換えの割合は54.4% (前週53.6%) と、3年半ば以来の高水準となった。30年固定金利型の住宅ローン金利は4.33% (前週4.33%)、15年固定金利型は3.47% (前週3.41%)。

(2) 欧州委員会が発表した7月のユーロ圏消費者信頼感指数速報値は-8.4となり、市場予想の-7.5を下回り、3ヵ月ぶりの低水準となった。中東やウクライナの情勢が域内の脆弱な景気回復を脅かしている現状が反映された。

23 : 35

《EIA 米週間在庫統計》

原油在庫・・・397万バレル減少

ガソリン在庫・・338万バレル増加

留出油在庫・・164万バレル増加

23 : 40

＜ NY 株式市場 序盤 ＞

序盤の株式市場は、米主要企業の 4-6 月期決算発表が相次ぐ中、業績が好調な企業の銘柄が買われる一方、利益を確定するための売りも出ており、やや方向感に欠ける動きが続いている。ダウ平均株価は、序盤から軟調な動きとなったものの、その後は下げ幅を縮小する動きとなっている。

＜ 海外の話題 ＞

ブラジル世論調査統計研究所が公表した最新の世論調査によると、10月の大統領選に向け、ルセフ大統領の支持率が38%となり、決選投票でいずれの候補に対しても勝利する情勢となっている。主要対抗馬である野党・社会民主党のアエシオ・ネベス氏の支持率は22%、ブラジル社会党のエドゥアルド・カンボス氏は8%だった。調査結果はテレビのグローバルで放映された。

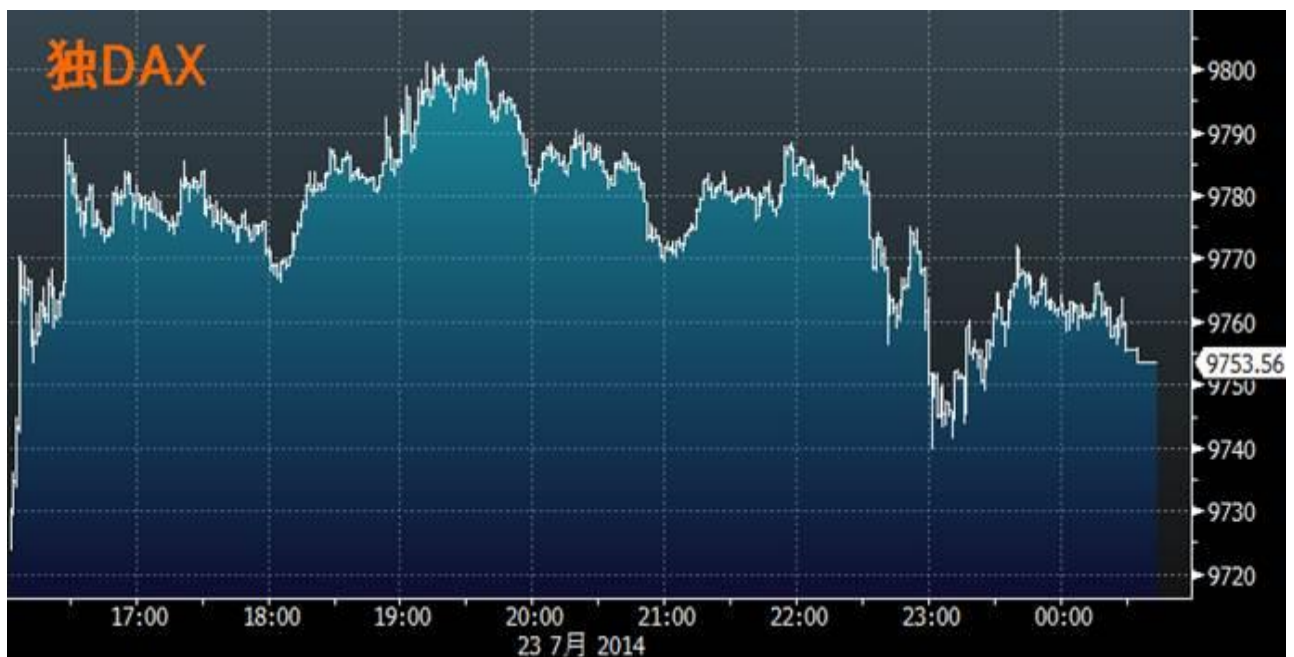
各候補の支持率は、6月調査（ルセフ大統領＝39%、ネベス氏＝21%、カンボス氏＝10%）からほぼ変わらず。ルセフ政権に対する支持率は前回と変わらずの31%、大統領個人の支持率も44%で変わらずとなった。調査では、決選投票がルセフ大統領とネベス氏の対決となった場合は41%対33%でルセフ大統領が勝利、カンボス氏と対決した場合は41%対29%で大統領が勝利するという結果となった。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6798.15	+2.81
仏 CAC40	4376.32	+6.80
独 DAX	9753.56	+19.23
ストック欧州 600 指数	342.86	+0.42
ユーロファースト 300 指数	1375.69	+1.94
スペイン IBEX35 指数	10659.10	+10.20
イタリア FTSE MIB 指数	20831.26	-42.24
南ア アフリカ全株指数	51910.92	-20.41

(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期待による買い先行したものの、ウクライナ情勢への警戒感も根強く、主要株価は上値の重い展開が続いた。



(出所:ブルームバーグ)

1 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 17095.73 (-17.81) 、S&P500 1988.22 (+4.69) ナスダック 4476.63 (+20.61)

≪ NY 債券市場 ・午前≫

序盤のニューヨーク債券市場は、新規の手掛かり材料に乏しい中、ウクライナや中東情勢への懸念を背景に安全資産とされる米国債の逃避買いが先行した。ただ、最近の相場上昇の反動で利益確定売りも出ており、上げ幅は限定的となった。

午前の利回りは、30 年債が 3.25% (前日 3.25%)、10 年債が 2.46% (2.47%)、7 年債が 2.11% (2.12%)、5 年債が 1.65% (1.66%)、3 年債が 0.95% (0.96%)、2 年債が 0.47% (0.47%)。

≪欧州のポイント≫

①英中銀が公表した今月の MPC (金融政策委員会) の議事録によれば、MPC は政策金利を過去最低の 0.50% に、資産購入枠を 3750 億ポンド (約 64 兆 7800 億円) で維持することを全会一致で決定した。また、成長が一段と定着する中で、利上げが回復を頓挫させるリスクは後退したと一部メンバーが指摘し始めたことも明らかになった。

英経済は 4-6 月に 6 四半期連続でプラス成長になったとみられ、GDP の伸び率は金融危機以前の水準に戻り通あるため、当局者の焦点は 7 年ぶりとなる利上げのタイミングに移りつつある。議事録では「利上げの第一弾についてはデータに左右されるもので、事前設定のタイミングは MPC にはない」とし、景気拡大が一段と定着することで「小幅な利上げが成長を損ねインフレ率が中期的な目標を下回ったままになるリスクは後退しているとの一つの解釈がある」と説明。

②スペイン中銀は、今年と来年の成長率予想を上方修正し、2014 年は 1.2% から 1.3% に、2015 年は 1.7% から 2.0% に引き上げた。第 2・四半期の成長率は、前四半期比で 0.5% とした。スペイン中銀は、「民間の国内消費支出と企業投資が、第 2・四半期の GDP を主導した。内需の段階的拡大で 2013 年半ばに景気回復が始まって以降、このパターンが続いている」と指摘した。

③EU の閣僚理事会は、リトアニアの単一通貨ユーロ導入を承認すると最終決定した。リトアニアは 2015 年 1 月 1 日から 19 番目のユーロ導入国となり、自国通貨リタスを廃止する。リトアニアのブトケビチウス首相は「リトアニアの努力が報われた。欧州統合の深化は安全保障の強化にもつながる」とコメントした。

2 : 00

ニューヨーク州「AA」を「AA+」に格上げ～米格付け会社

3 : 45

NY 金は、中心限月前日比 1.60 ドル安の 1 オンス=1304.70 ドルで取引を終了した。

4 : 10

NY 原油は、中心限月が前日比 0.73 ドル高の 1 バレル=102.12 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1304.70	-1.60
NY 原油	103.12	+0.73

(出所:SBILM)

≪ NY 金市場 ≫

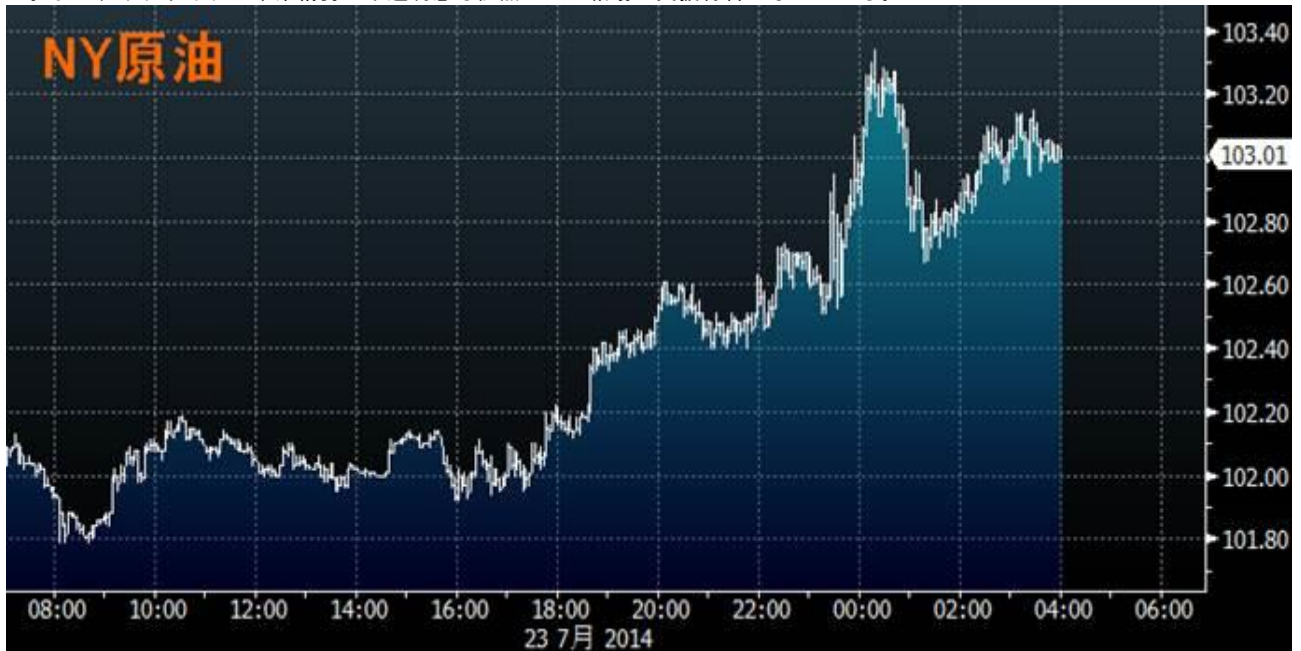
NY 金は、ドルが主要通貨に対して上昇したのにつれて、ドルの代替資産とされる金売る動きが先行した。ただ、ウクライナや中東情勢への懸念も引き続き相場の下支え要因となっており、下げ幅は限定的となった。



(出所:ブルームバーグ)

《 NY 原油市場 》

NY原油は、米石油在庫統計で、原油在庫が予想以上に減少したことから需給の緩みに対する懸念が後退し、買いが優勢となった。また、ウクライナや中東情勢の不透明感も依然として相場の支援材料となっている。



(出所:ブルームバーグ)

6 : 00

《 経済指標の結果 》

ニュージーランド政策金利 3.50% (予想 3.50%・前回 3.25%)



(出所:ブルームバーグ)



(出所: ネットダニアー)

主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	17086.63	-26.91	17121.05	17058.05
S&P500 種	1987.01	+3.48	1989.23	1982.44
ナスダック	4473.70	+17.68	4480.73	4457.95

(出所: SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、米主要企業の4-6月期決算発表が相次ぐ中、業績が好調な企業の銘柄が買われる一方、利益確定の売りも出ており、序盤から方向感に欠ける展開が続いた。ダウ平均株価は、序盤から軟調な動きとなったものの、その後は下げ幅を縮小する動きとなったものの、上値の重い展開が続いた。ナスダックとS&P500は続伸となり、S&Pは終値ベースで最高値を更新する動きとなった。

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	101.51	101.55	101.37
EUR/JPY	136.64	136.76	136.50
GBP/JPY	172.95	173.11	172.62
AUD/JPY	95.97	96.02	95.75
NZD/JPY	88.27	88.29	88.00
EUR/USD	1.3463	1.3474	1.3456
AUD/USD	0.9454	0.9458	0.9436

(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材料に乏しい中、序盤のドル円・クロス円は小動きとなった。その後は下落した株価が堅調な動きとなったことから値を戻す場面もあったが、ウクライナやパレスチナ情勢への懸念を背景に、円買いも出ており、上値の重い展開が続いた。



(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。