

NY マーケットレポート (2014 年 7 月 24 日)

NY 市場では、序盤に発表された米新規失業保険申請件数が、2006 年 2 月 18 日までの週以来 8 年 5 ヶ月ぶりの低水準に改善したことを好感して、ドル円・クロス円は堅調な動きとなった。しかし、その後に発表された米新築住宅販売件数が、市場予想を大きく下回ったことや、IMF が世界経済の成長見通しを引き下げたことを受けて、ドル円・クロス円は引けにかけて上値の重い展開が続いた。

2014/ 7/24 (木)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	101.45	101.59	101.42
EUR/JPY	136.69	136.73	136.37
GBP/JPY	172.89	173.06	172.76
AUD/JPY	95.86	96.18	95.69
EUR/USD	1.3474	1.3476	1.3438

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	101.65	101.45
EUR/JPY	137.03	136.64
GBP/JPY	173.01	172.64
AUD/JPY	95.98	95.81
EUR/USD	1.3485	1.3467

*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	15284.42	-44.14
ハンセン指数	24141.50	+169.63
上海総合	2105.06	+26.57
韓国総合指数	2026.62	-1.70
豪ASX200	5587.80	+11.05
インドSENSEX指数	26271.85	+124.52
シンガポールST指数	3353.89	+13.19

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6821.46	+23.31
仏CAC40	4410.65	+34.32
独DAX	9794.06	+40.50
ST欧州600	344.33	+1.47
西IBEX35指数	1086.70	+201.60
伊FTSE MIB指数	21255.60	+424.34
南ア 全株指数	51621.52	-289.40

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	101.77	101.86	101.64
EUR/JPY	137.02	137.19	136.93
GBP/JPY	172.89	173.07	172.66
AUD/JPY	95.87	96.00	95.77
NZD/JPY	87.34	87.46	87.28
EUR/USD	1.3465	1.3480	1.3458
AUD/USD	0.9421	0.9442	0.9411

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17083.80	-2.83
S&P500	1987.98	+0.97
NASDAQ	4472.11	-1.59
その他主要株	終値	前日比
カナダトロント総合	15394.45	+0.07
ブラジルボルサ指数	44420.38	+221.37
ブラジルボベスパ指数	57977.56	+557.60

7/25 経済指標スケジュール

08:01 【英】7月ホームトラック住宅価格
08:30 【日】6月全国消費者物価指数
08:50 【日】6月企業向けサービス価格指数
10:00 【NZ】7月ANZ企業景況感
14:00 【シンガポール】6月鉱工業生産
15:00 【独】8月GfK消費者信頼感調査
16:00 【トルコ】6月貿易収支
16:30 【スウェーデン】6月小売売上高
16:30 【スウェーデン】6月貿易収支
17:00 【独】7月IFO景気指数
17:00 【欧】6月マネーサプライM3
17:30 【英】5月サービス業指数
17:30 【英】2Q GDP
21:30 【米】6月耐久財受注
22:00 【メキシコ】6月貿易収支

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1290.80	-13.90
NY 原油	102.07	-1.05
CMEコーン	369.50	-1.25
CBOT 大豆	1084.75	+8.25

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.49%	0.47%
3年債	0.99%	0.94%
5年債	1.70%	1.65%
7年債	2.17%	2.11%
10年債	2.51%	2.46%
30年債	3.30%	3.26%

7/25 主要会議・講演・その他予定

(出所: SBILM)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 101.64 ユーロ/円 136.99 ユーロ/ドル 1.3479

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	6809.94	+11.79	ダウ INDEX FUTURE	17046	+21
仏 CAC40	4410.90	+34.58	S&P500 FUTURE	1984.60	+3.80
独 DAX	9799.63	+46.07	NASDAQ FUTURE	3988.75	+13.25

(出所:SBILM)

《企業決算》

米 3 M

第 2 四半期 1 株利益 1.91 ドル (予想 1.91 ドル)

米 キャタピラー

第 2 四半期 調整後の 1 株利益は 1.69 ドル (予想 1.52 ドル)

米 フォード

第 2 四半期 調整後の 1 株利益 0.40 ドル (予想 0.36 ドル)

21:30

《経済指標の結果》

新規失業保険申請件数 28.4 万件 (予想 30.7 万件・前回 30.3 万件) 前回発表の 30.2 万件から 30.3 万件に修正

失業保険継続受給者数 250.0 万人 (予想 251.0 万人・前回 250.8 万人) 前回発表の 250.7 万人から 250.8 万人に修正



(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

14/07/19	284,000	-19,000	302,000	*****	*****
14/07/12	303,000	-2,000	309,250	2,500,000	1.9%
14/07/05	305,000	-11,000	312,000	2,507,000	1.9%
14/06/28	316,000	+3,000	315,250	2,586,000	2.0%
14/06/21	313,000	-1,000	314,500	2,575,000	2.0%
14/06/14	314,000	-4,000	312,250	2,568,000	2.0%
14/06/07	318,000	+5,000	315,500	2,559,000	1.9%
14/05/31	313,000	+9,000	310,500	2,615,000	2.0%
14/05/24	304,000	-23,000	312,500	2,603,000	2.0%
14/05/17	327,000	+29,000	322,750	2,623,000	2.0%
14/05/10	298,000	-23,000	323,500	2,648,000	2.0%
14/05/03	321,000	-24,000	325,250	2,666,000	2.0%

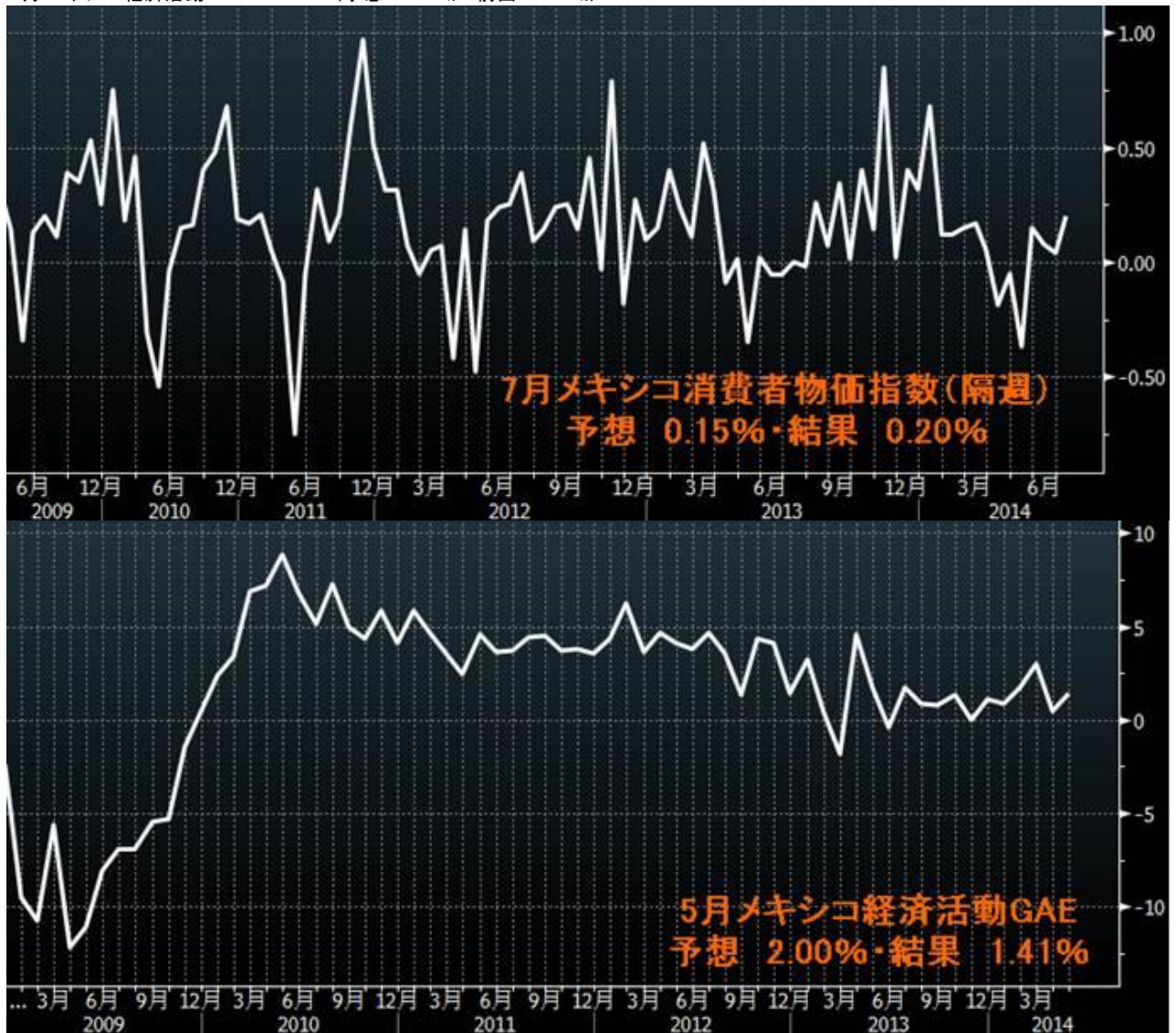
受給者数は集計が1週間遅れる

22:00

《経済指標の結果》

7月メキシコ消費者物価指数(隔週) 0.20% (予想 0.15%・前回 0.04%)

5月メキシコ経済活動GAE 1.41% (予想 2.00%・前回 0.50%)



(出所:ブルームバーグ)

22 : 34

米主要株価

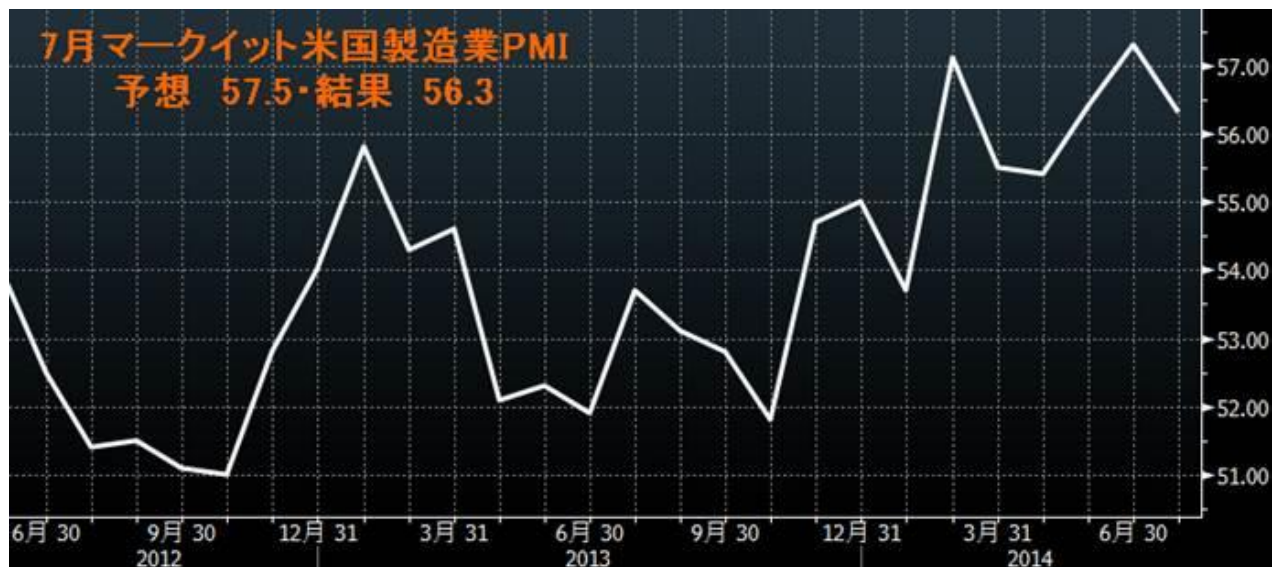
米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17088.89	+2.26
ナスダック	4484.45	+10.75

(出所:SBILM)

22 : 45

◀ 経済指標の結果 ▶

7月マークイット米国製造業 PMI 56.3 (予想 57.5・前回 57.3)



(出所:ブルームバーグ)

23 : 00

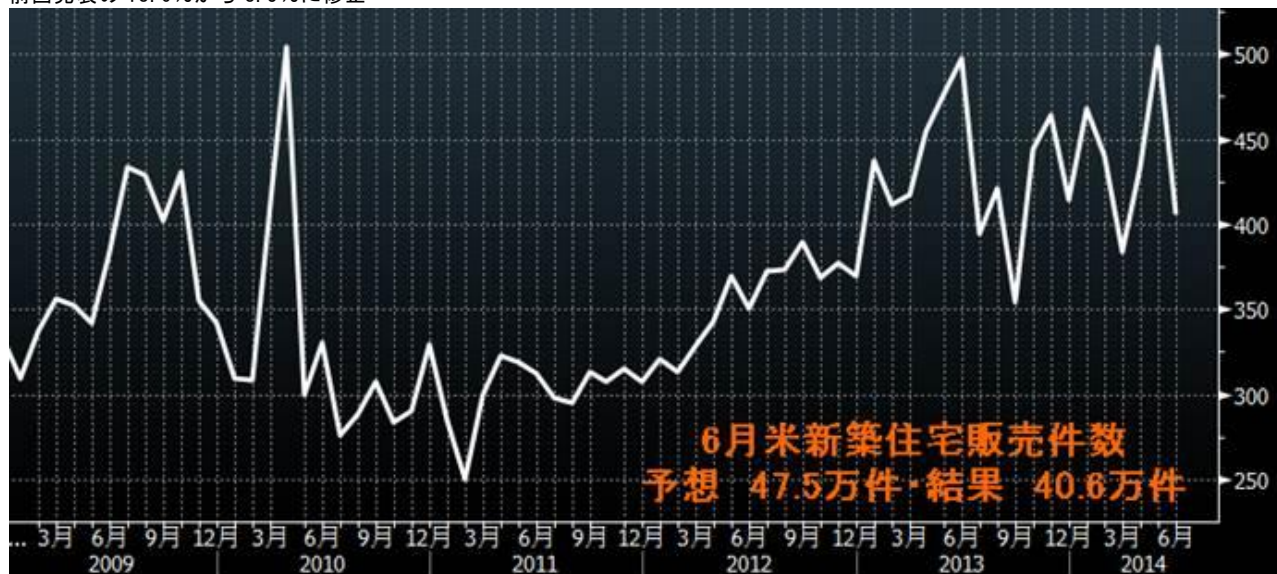
◀ 経済指標の結果 ▶

6月米新築住宅販売件数 40.6万件 (予想 47.5万件・前回 44.2万件)

前回発表の50.4万件から44.2万件に修正

6月米新築住宅販売件数 (前月比) -8.1% (予想 -5.8%・前回 8.3%)

前回発表の18.6%から8.3%に修正



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

《新築住宅販売》

	6月	5月	4月	3月	2月	1月
販売戸数	40.6	44.2	40.8	4030	43.2	45.7
前月比 (%)	-8.1	8.3	1.2	-6.7	-5.5	3.4
	(万件)					
	6月	5月	4月	3月	2月	1月
北東部	2.4	3.0	2.1	2.5	2.3	3.0
中西部	6.7	7.3	6.9	5.6	5.6	5.1
南部	20.9	23.1	22.4	23.3	25.9	25.6
西部	10.6	10.8	9.4	8.9	9.4	12.0
	(万件)					

23 : 30

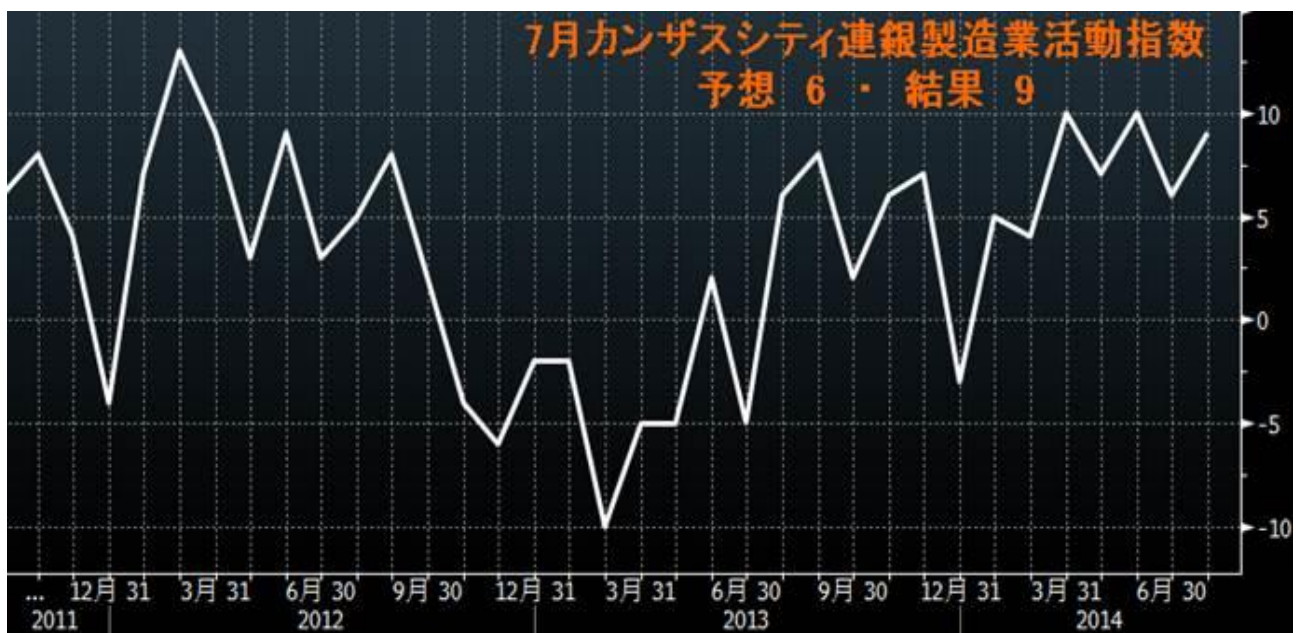
《 NY 株式市場 序盤 》

序盤の株式市場は、米主要企業の決算発表が相次ぐ中、業績の内容に応じて売り買いが交錯する動きが続いており、主要株価は狭いレンジ内の展開が続いている。最高益を更新したフェイスブックが高い一方、大規模リコールの費用を計上したゼネラル・モーターズは下落した。

0 : 00

《 経済指標の結果 》

7月カンザスシティ連銀製造業活動指数 9 (予想 6・前回 6)



IMF 最新の世界経済見通しを発表

- ・「2014 年の世界成長見通しは 3.4%、4 月時点の予想は 3.6%」
- ・「2014 年の日本の成長率見通しは 1.6%、4 月時点の予想は 1.4%」
- ・「2014 年のユーロ圏成長率見通しは 1.1%、4 月時点の予想 1.2%」

《 経済指標のポイント 》

(1) 米失業保険申請件数は、前週比-1.9 万件の 28.4 万件と、市場予想の 30.7 万件を大きく下回り、2006 年 2 月 18 日までの週以来 8 年 5 カ月ぶりの低水準となった。申請件数の 4 週移動平均は、前週比-7250 人の 30 万 2000 人と、2007 年 5 月 19 日までの週以来の低水準となった。また、集計が 1 週遅れる失業保険継続受給者数は、前週比-0.8 万人の 250.0 万人で、2007 年 6 月 16 日までの週以来の低水準となった。受給者総数の 4 週移動平均は、前週比-1.7 万人の 254 万 2250 人で 2007 年 10 月 13 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 1.9%となった。

(2) 6 月の米新築住宅販売件数は、年率換算で前月比-8.1%の 40.6 万件と、市場予想の 47.9 万件を大きく下回り、3 カ月ぶりに減少した。前年同月比も-11.5%となった。また、前月分も当初の 50.4 万件から 44.2 万件に下方修正された。寒波の影響で今年に入り減速感の出ていたものの、天候の改善につれて 5 月には 50 万件台まで持ち直したものの、やや反動が出て再び減少に転じた。

①住宅在庫は、6 月末時点で前月比+3.1%の 19.7 万件。販売に対する在庫の比率は 5.8 カ月となり、適正水準とされる 6.0 カ月を引き続き下回ったものの、在庫不足は傾向は弱まる傾向となっている。

②地域別では、北東部が-20.0%、中西部は-8.2%、最大市場の南部が-9.5%、西部は-1.9%となった。

③販売物件の中間価格は、前月比-3.2%の 27 万 3500 ドル、平均価格は前月比+3.5%の 33 万 1400 ドル。

(3) 7 月の米マークイット製造業景気指数の速報値は 56.3 となり、前月の 57.3 を下回る結果となった。ただ、改善・悪化の判断基準となる 50 は維持している。生産指数は 60.4 (前月 61)、雇用指数は 51.2 (54) と 2013 年 9 月以来の低水準となった。マークイット担当者は、今回の統計は、下半期に入るにあたり製造業部門が年率換算で約 8%成長していたことを示している。伸びは第 3・四半期に入っても維持されていると見られると指摘している。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6821.46	+23.31
仏 CAC40	4410.65	+34.32
独 DAX	9794.06	+40.50
ストック欧州 600 指数	344.33	+1.47
ユーロファースト 300 指数	1381.97	+6.28
スペイン IBEX35 指数	10860.70	+201.60
イタリア FTSE MIB 指数	21255.60	+424.34
南ア アフリカ全株指数	51621.52	-289.40

(出所:SBILM)

《 欧州株式市場 》

欧州株式市場は、ユーロ圏の景況感指標の改善を受けて欧州経済の先行きに対する期待が高まったことから、主要株価は堅調な動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)

1 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 17100.54 (+13.96) 、S&P500 1990.29 (+3.28) ナスダック 4484.14 (+10.45)

《欧州のポイント》

①フランスのバルス首相は、「現在のユーロの水準は高過ぎると認識している」と指摘。その上で、EU の安定成長協定が定める財政目標への取り組みは一段の柔軟性が認められるべきと主張し「各国政府が実施する政策に合わせて、EU が一段の措置を取るべきだ」と述べた。

②ドイツ連邦銀行のバイトマン総裁は、EU 加盟は英国に経済的恩恵をもたらしており脅威はほとんどないとして、EU にとどまるよう促した。政治問題に対し沈黙する連銀の伝統を破り、総裁は英国が「引き続き声をあげてくれれば」EU にとって有益と述べた。財界・銀行幹部との会合で総裁は、「英国の貢献により EU はより堅固になった」と指摘。英国と EU 諸国の貿易は加盟により半分以上増加したと語った。また、「英国が加盟から恩恵を受けるのと同様、EU も英国の加盟継続により恩恵を受ける」と述べた。

③メルシュ ECB 専務理事は、ユーロ圏短期金融市場が活気を取り戻しているとの見方を示した。ただ、金融危機前の流動性の水準には達していないとした。理事は、インタビューで「われわれが目にはしているのは、短期金融市場の再活性化だ。危機前の流動性の水準には戻っていないかもしれないが、流動性はより安全な水準にある」と述べた。また、「回復の過程では銀行貸し出しを復調させることが特に重要で、回復の一環でもある」とした。そのうえで、ECB は銀行貸し出しを後押しすることが可能で、新たな長期資金供給オペにもその狙いがあると語った。

④スペイン経済省のラトーレ経済担当次官は、9 月に予定される来年度の予算編成の際に経済成長率見通しを引き上げる可能性があると明らかにした。ラトーレ氏は「経済活動の加速が幅広く示されており、上方修正となるだろう」と述べた。政府の今年の成長率予想はこれまでのところ 1.2%で、来年は 1.8%となっている。

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、米週間失業保険申請件数が市場予想に反して減少し、約 8 年 5 ヶ月ぶりの低い水準になったことで雇用情勢が改善しているとの見方が広がり、安全資産とされる米国債を売る動きが先行した。ただ、その後は 6 月の新築住宅販売戸数が予想より悪かったことや、ウクライナや中東情勢への警戒感が根強いことによる買い戻しも入り、値動きは限定的となった。

午前の利回りは、30 年債が 3.30%（前日 3.26%）、10 年債が 2.51%（2.47%）、7 年債が 2.16%（2.12%）、5 年債が 1.69%（1.65%）、3 年債が 0.98%（0.95%）、2 年債が 0.49%（0.47%）。

2 : 00

《米 10 年物 TIPS 入札》

最高落札利回り・・・0.249%（前回 0.339%）

最低落札利回り・・・0.150%（前回 0.245%）

最高利回り落札比率・・・60.46%（前回 85.22%）

応札倍率・・・2.49 倍（前回 2.91 倍）

発行額・・・150 億ドル（前回 130 ドル）

3 : 45

NY 金は、中心限月前日比 13.90 ドル安の 1 オンス＝1290.80 ドルで取引を終了した。

4 : 30

NY 原油は、中心限月が前日比 1.05 ドル安の 1 バレル＝102.07 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1290.80	-13.90
NY 原油	102.07	-1.05

（出所：SBILM）

《 NY 金市場 》

NY 金は、中国の製造業関連の経済指標が改善したほか、米失業保険申請件数も市場予想より良い内容だったことから、世界景気の回復基調が続いているとの見方が広がり、安全な資産とされる金を売る動きが優勢となった。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、中国の製造業関連指標が改善を好感して買いが先行したものの、その後は IMF が今年の世界全体の経済成長率見通しを下げ下げたことを受けて、売りが優勢となった。



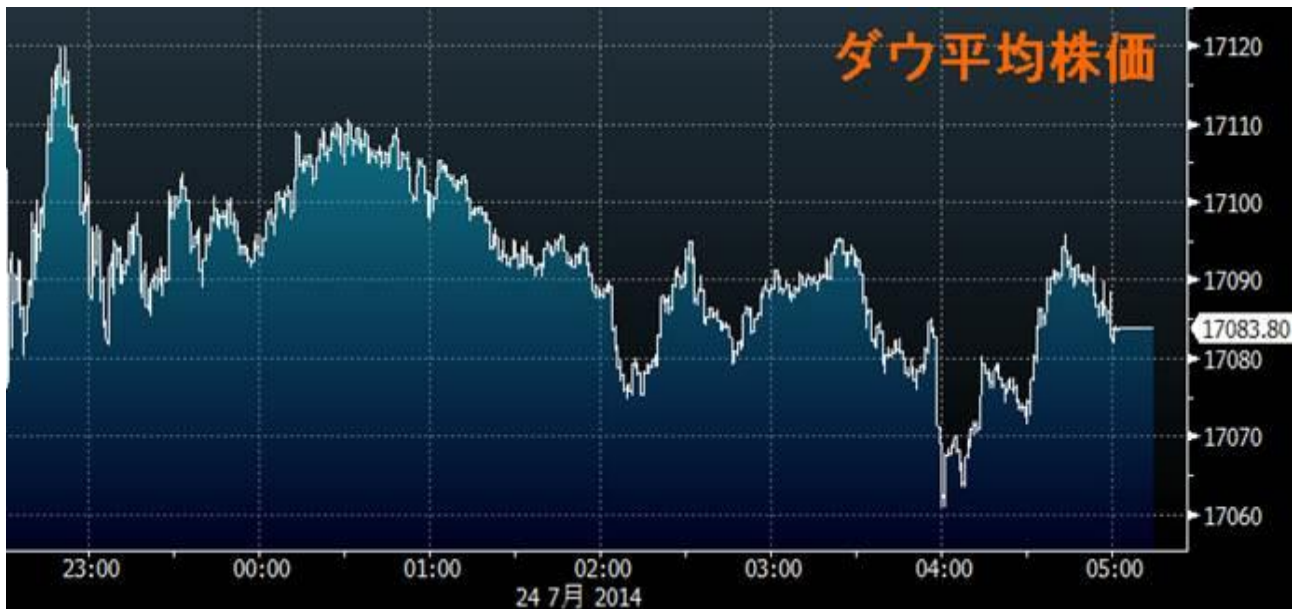
(出所:ブルームバーグ)

主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	17083.80	-2.83	17119.83	17061.07
S&P500 種	1987.98	+0.97	1991.39	1985.79
ナスダック	4472.11	-1.59	4485.50	4465.94

(出所:SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、米主要企業の決算発表が相次いだことを受けて、主要株価は序盤堅調な動きとなった。しかし、米住宅関連の経済指標が予想外の悪化となったことから、上値の重い動きが続いた。ダウ平均株価は、序盤は堅調な動きとなり、一時前日比 33 ドル高まで上昇する動きとなった。しかし、その後はマイナス圏まで下落するなど、上値の重い動きが続いた。なお、S&P500 は 2 日連続で最高値を更新する動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	101.77	101.86	101.64
EUR/JPY	137.02	137.19	136.93
GBP/JPY	172.89	173.07	172.66
AUD/JPY	95.87	96.00	95.77
NZD/JPY	87.34	87.46	87.28
EUR/USD	1.3465	1.3480	1.3458
AUD/USD	0.9421	0.9442	0.9411

(出所: SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、欧州の製造業や米国の雇用関連の経済指標が予想より改善したことを受けて、ドル円・クロス円は序盤から堅調な動きとなった。しかし、その後に発表された米住宅関連の経済指標が悪化したことや、株価が上値の重い動きとなったことを受けて、ドル円・クロス円は引けにかけて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。