

NY マーケットレポート (2014年7月31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、市場予想とほぼ一致した結果となったものの、8年ぶりの低水準となった前回分が下方修正されたことを好感して、序盤のドル円・クロス円は堅調な動きとなった。しかし、米格付け会社がアルゼンチンの格付けを「選択的デフォルト」に引き下げたことを受けて、株価が大きく下落したことや、シカゴ購買部協会景気指数が予想を大きく下回る結果となったことを受けて、投資家のリスク回避の動きが強まり、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。ただ、週末の米雇用統計に結果に対する期待感などから値を戻す動きが見られたものの、株価が下げ幅を拡大する動きとなったこともあり、上値の重い動きとなった。

2014/7/31 (木)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	102.86	102.89	102.73
EUR/JPY	137.78	137.80	137.61
GBP/JPY	173.81	174.01	173.78
AUD/JPY	95.73	95.95	95.70
EUR/USD	1.3395	1.3401	1.3385

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	102.92	102.76
EUR/JPY	137.84	137.59
GBP/JPY	173.82	173.41
AUD/JPY	95.74	95.49
EUR/USD	1.3401	1.3380

*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	15620.77	-25.46
ハンセン指数	24756.85	+24.64
上海総合	2201.56	+20.32
韓国総合指数	2076.12	-6.49
豪ASX200	5632.91	+10.03
インドSENSEX指数	25894.97	-192.45
シンガポールST指数	3374.06	+20.41

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6730.11	-43.33
仏CAC40	4246.14	-66.16
独DAX	9407.48	-186.20
ST欧州600	335.99	-5.35
西IBEX35指数	10707.20	-230.20
伊FTSE MIB指数	20570.80	-316.73
南ア 全株指数	51396.07	-374.52

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	102.85	103.00	102.74
EUR/JPY	137.69	137.82	137.51
GBP/JPY	173.64	173.78	173.46
AUD/JPY	95.55	95.70	95.52
NZD/JPY	87.36	87.44	87.15
EUR/USD	1.3387	1.3400	1.3371
AUD/USD	0.9291	0.9308	0.9279

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	16563.30	-317.06
S&P500	1930.67	-39.40
NASDAQ	4369.77	-93.13
その他主要株	終値	前日比
トロント総合	15330.74	-194.08
ボルサ指数	43817.69	-493.37
ボベスパ指数	55829.41	-1048.56

8/1 経済指標スケジュール

08:30	【豪】7月AiG製造業指数
10:00	【中】7月製造業PMI
10:30	【豪】2Q生産者物価指数
10:45	【中】7月HSBC製造業PMI
14:00	【日】7月自動車販売台数
16:50	～ 17:30
	【仏】【独】【欧】【英】7月製造業PMI
17:00	【ノルウェー】7月失業率
18:00	【南ア】7月カギンPMI
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】6月個人所得
21:30	【米】6月個人支出
21:30	【米】6月PCEコア・デフレーター
22:55	【米】7月ミシガン大学消費者信頼感指数
23:00	【米】7月ISM製造業景況指数
23:00	【米】6月建設支出

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1282.80	-14.10
NY 原油	98.17	-2.10
CME コーン	367.00	-4.50
CBOT 大豆	1082.00	+0.75

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.53%	0.56%
3年債	1.00%	1.02%
5年債	1.76%	1.77%
7年債	2.24%	2.22%
10年債	2.56%	2.56%
30年債	3.32%	3.31%

8/1 主要会場・講演・その他予定

・黒田日銀総裁 講演

(出所: SBILM)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 102.73 ユーロ/円 137.67 ユーロ/ドル 1.3384

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	6761.12	-12.32	ダウ INDEX FUTURE	16728	-93
仏 CAC40	4273.89	-38.41	S&P500 FUTURE	1953.30	-11.80
独 DAX	9483.80	-109.88	NASDAQ FUTURE	9341.50	-27.00

(出所:SBILM)

《企業決算》

米エクソンモービル

第2四半期 1株利益 2.05ドル (予想 1.86ドル)

米マスターカード

第2四半期の1株利益は0.80ドル (予想 0.77ドル)

21:00

《経済指標の結果》

6月南ア貿易収支 -2億 ZAR (予想 -63億 ZAR・前回 -74億 ZAR)

前回発表の-66億 ZAR から-74億 ZAR に修正



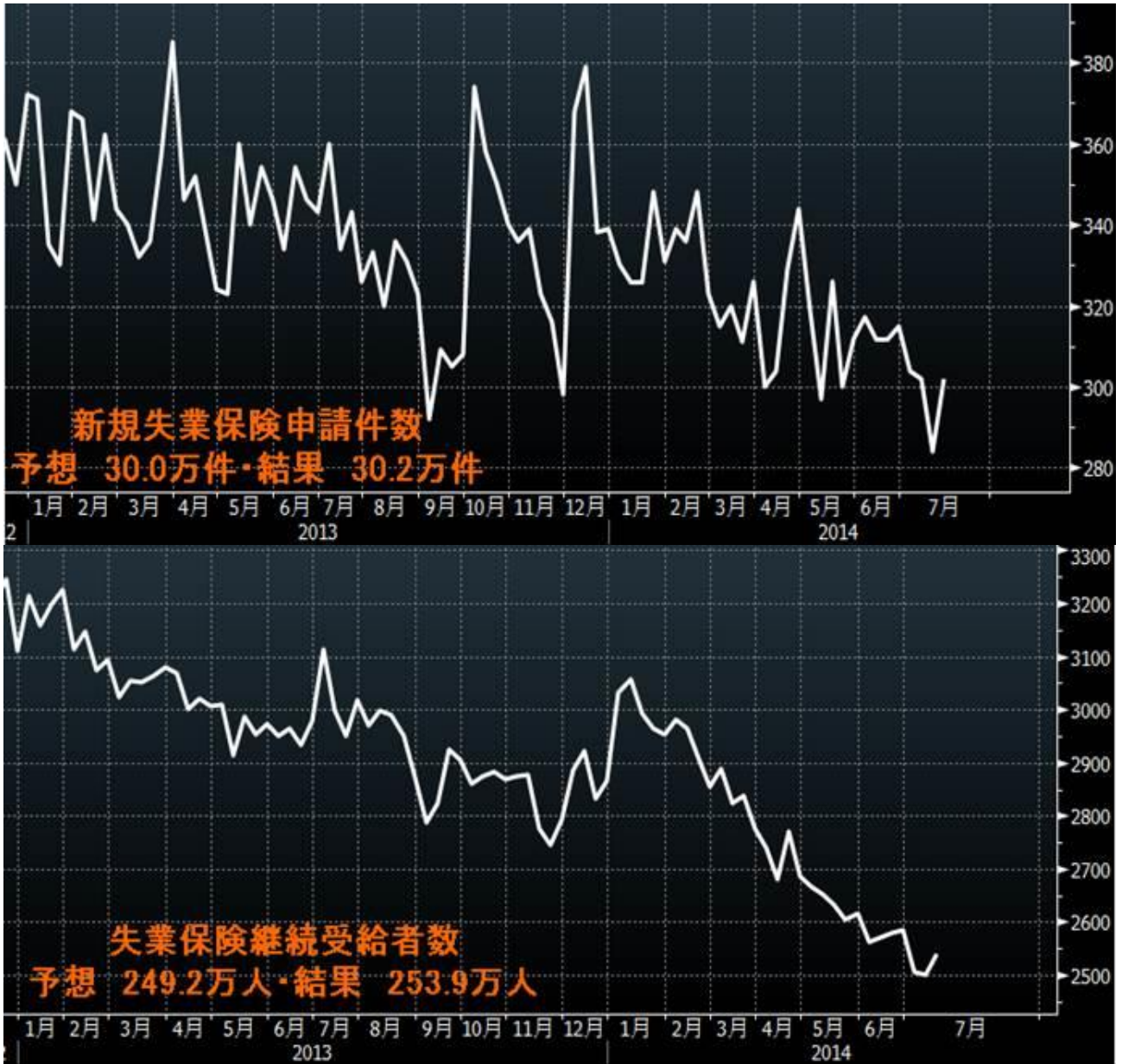
(出所:ブルームバーグ)

21:30

< 経済指標の結果 >

新規失業保険申請件数 30.2万件 (予想 30.0万件・前回 27.9万件)
 前回発表の28.4万件から27.9万件に修正

失業保険継続受給者数 253.9万人 (予想 249.2万人・前回 250.8万人)
 前回発表の250.0万人から250.8万人に修正



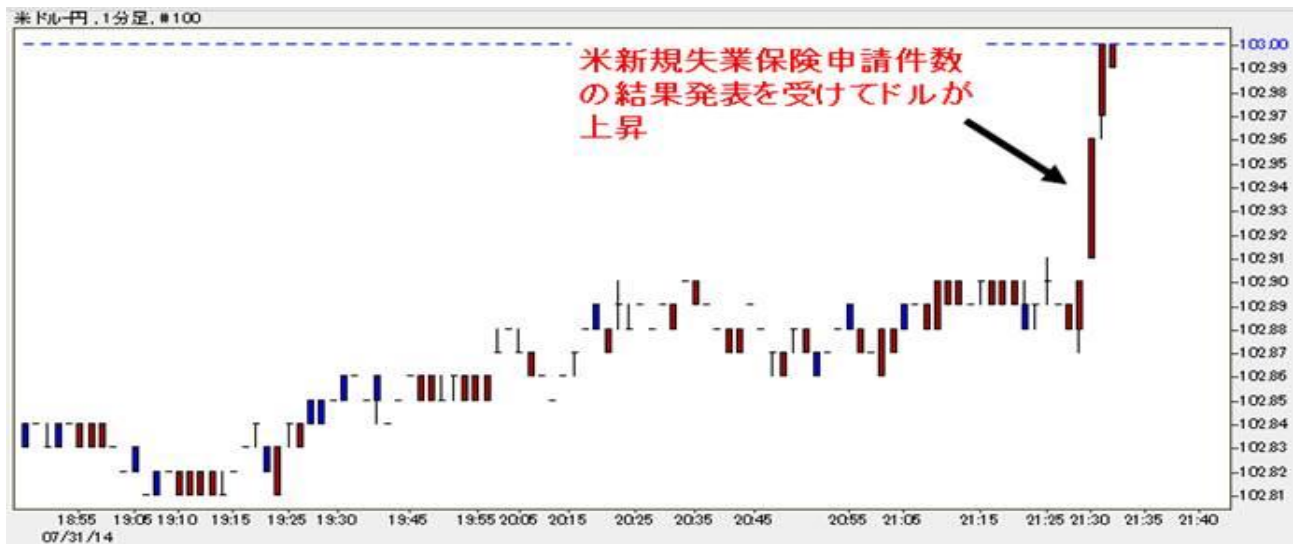
(出所:ブルームバーグ)

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
14/07/26	302,000	+23,000	297,250	*****	*****
14/07/19	279,000	-24,000	300,750	2,539,000	1.9%
14/07/12	303,000	-2,000	309,250	2,508,000	1.9%
14/07/05	305,000	-11,000	312,000	2,508,000	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



(出所: ネットダニアー)

21:30

《 経済指標の結果 》

2Q米雇用コスト指数(前期比) 0.7% (予想 0.5%・前回 0.3%)



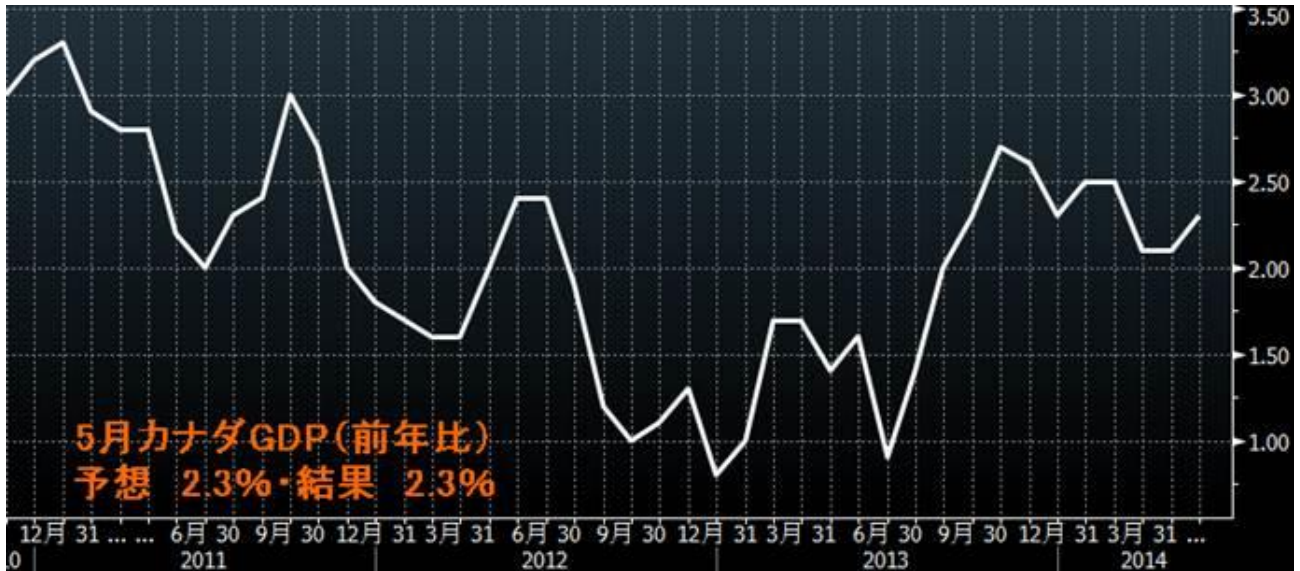
(出所: ブルームバーグ)

21 : 30

< 経済指標の結果 >

5月カナダ GDP (前月比) 0.4% (予想 0.4%・前回 0.1%)

5月カナダ GDP (前年比) 2.3% (予想 2.3%・前回 2.1%)

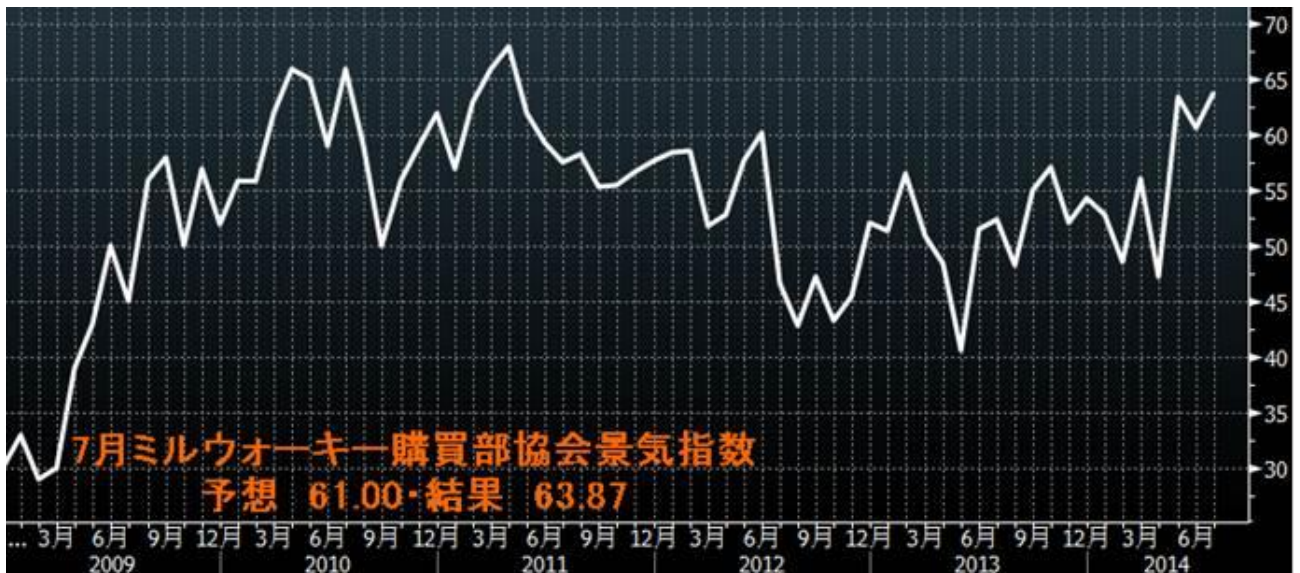


(出所:ブルームバーグ)

22 : 06

< 経済指標の結果 >

7月ミルウォーキー購買部協会景気指数 63.87 (予想 61.00・前回 60.57)



(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	16779.72	-100.64
ナスダック	4420.93	-41.97

(出所:SBILM)

22:35

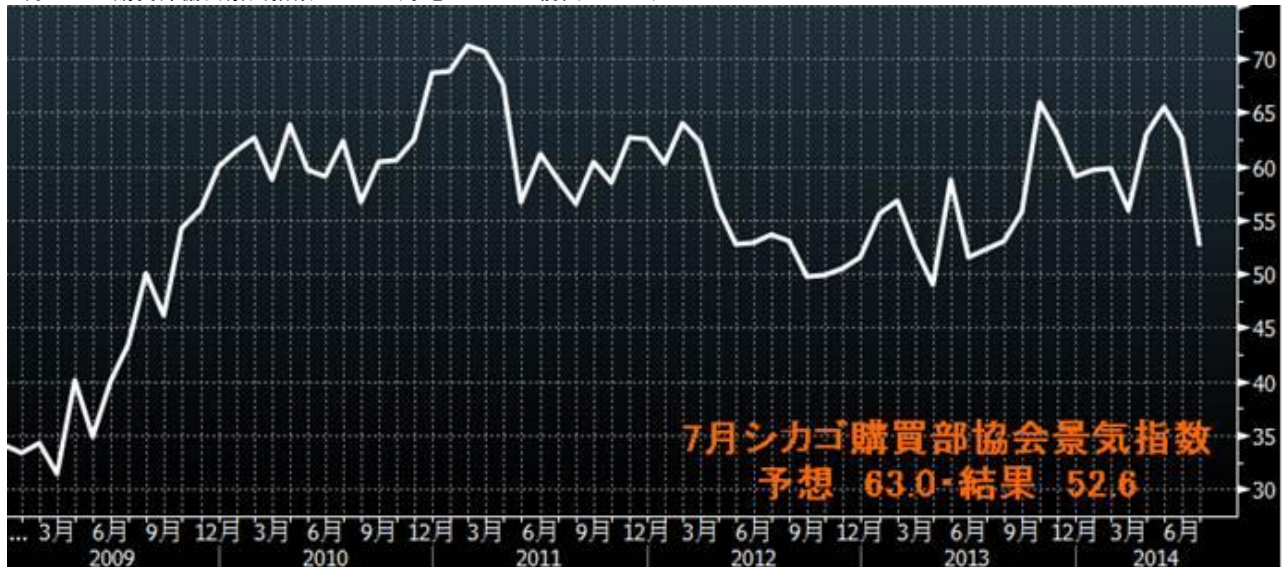
IMF、日本経済年次審査を発表

- ・「今年の日本GDPは1.6%成長、来年1.1%成長に」
- ・「円は中期的ファンダメンタルズと「おおむね合致」
- ・「現時点で追加緩和は必要ない」

22:45

◀ 経済指標の結果 ▶

7月シカゴ購買部協会景気指数 52.6 (予想 63.0・前回 62.6)



(出所:ブルームバーグ)

指標結果データ

◀ シカゴ購買部協会景気指数 ▶

7月・・・6月・・・5月・・・4月・・・3月・・・2月

景気指数・・・52.6・・・62.6・・・65.5・・・63.0・・・55.9・・・59.8

米ドル円、5分足、#100



(出所:ネットダニアー)

23 : 35

≪ NY 株式市場 序盤 ≫

序盤の株式市場は、ポルトガルの銀行大手の経営不安や、ウクライナ情勢への懸念を背景に、欧州主要市場の株価が軒並み下落したのを受けて、主要株価は序盤から軟調な動きとなった。また、アルゼンチンの債務問題をめぐる協議が決裂したことも懸念材料となった。ダウ平均株価は、序盤から軟調な動きとなり、一時前日比で 165 ドル安まで下落する動きとなっている。

≪ 経済指標のポイント ≫

(1) 米失業保険申請件数は、前週比+2.5 万件の 30.2 万件となり、市場予想の 30.1 万件とほぼ一致した。申請件数の 4 週移動平均は、前週比-3500 人の 29 万 7250 人で、2006 年 4 月 15 日までの週以来、約 8 年 3 ヶ月ぶりの低水準となった。また、集計が 1 週遅れる失業保険継続受給者数は、前週比+3.1 万人の 253.9 万人となった。受給者数の 4 週移動平均は、前週比-0.9 万人の 253 万 5250 人で 2007 年 10 月 13 日までの週以来の低い水準となった。なお、受給者比率は、前週から横ばいの 1.9%だった。

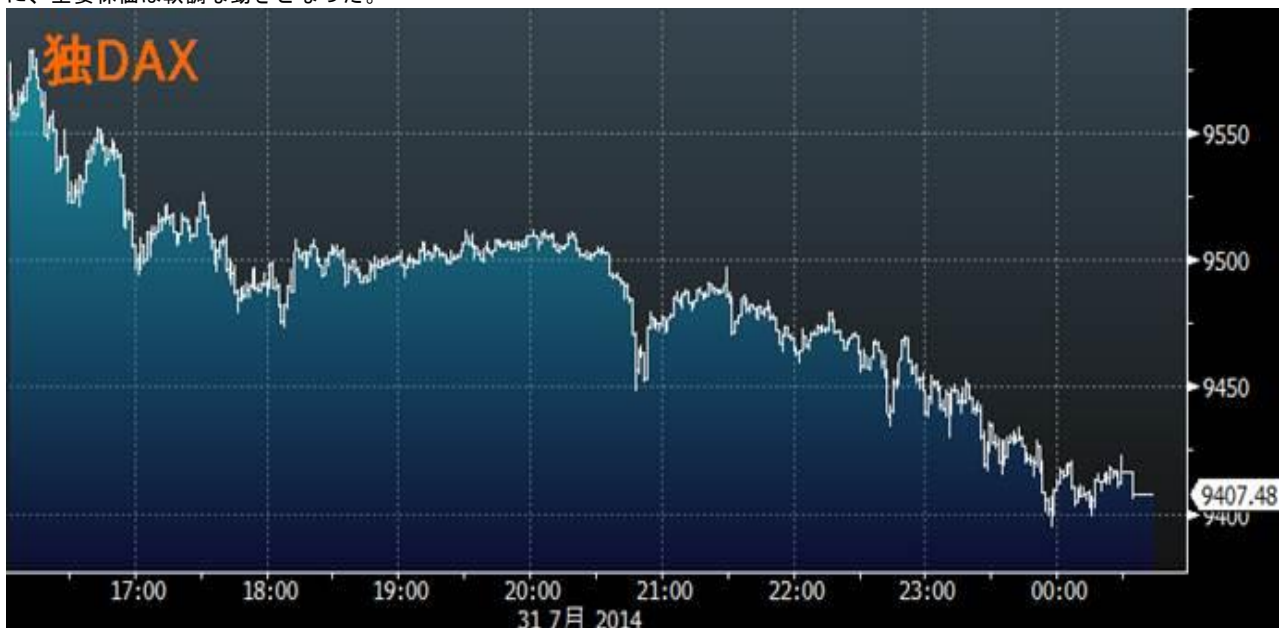
(2) 米 4-6 月期の雇用コスト指数（速報値）は、前期比+0.7%となり、市場予想の+0.5%を上回った。賃金・給与と医療保険などの諸手当はともに伸びたことが要因となった。前年同月比では+2.0%と、1-3 月期よりも伸び幅が拡大した。前期比ベースでは、賃金・給与が+0.6%、諸手当は+1.0%、前年同期比ベースでは賃金・給与が+1.8%、諸手当は+2.5%となった。また、民間企業の雇用コストは、前期比+0.8%、前年同期比+2.0%。政府部門の雇用コストは、前期比+0.5%、前年同期比+2.0%となった。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6730.11	-43.33
仏 CAC40	4246.14	-66.16
独 DAX	9407.48	-186.20
ストック欧州 600 指数	335.99	-5.35
ユーロファースト 300 指数	1349.34	-17.18
スペイン IBEX35 指数	10707.20	-230.20
イタリア FTSE MIB 指数	20570.80	-316.73
南ア アフリカ全株指数	51396.07	-374.52

(出所:SBILM)

≪ 欧州株式市場 ≫

欧州株式市場は、欧州企業業績への先行き警戒感に加えて、ポルトガルの銀行大手の経営不安やウクライナ情勢への懸念を背景に、主要株価は軟調な動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)

1:00

米主要株価・中盤

ダウ 16668.06 (-212.30)、S&P500 1944.43 (-25.64) ナスダック 4377.74 (-85.16)

≪ NY 債券市場 ・午前 ≫

序盤のニューヨーク債券市場は、米失業保険申請件数の4週移動平均が約8年3ヵ月ぶりの低水準となったことや、2Qの雇用コスト指数が予想以上に上昇したことを受けて売りが先行した。その後、シカゴ購買部協会指数が市場予想を大幅に下回ったことを受けて買い戻しが入る動きとなった。

午前の利回りは、30年債が3.32% (前日3.31%)、10年債が2.56% (2.56%)、7年債が2.24% (2.22%)、5年債が1.77% (1.77%)、3年債が1.01% (1.02%)、2年債が0.55% (0.56%)。

≪ 欧州のポイント ≫

①EU統計局が発表した7月のユーロ圏消費者物価指数の速報値は、前年比+0.4%となり、市場予想の+0.5%を下回り、2009年10月以来ほぼ5年ぶりの低い伸びとなった。エネルギー、食品、アルコール、タバコを除いたコアCPIは、前年比+0.8%となり、前月から横ばいだった。エネルギー価格は-1.0%、サービス価格は+1.3%となった。ユーロ圏のインフレ率は2013年10月以来、ECBが「危険水域」と呼ぶ1%未満にとどまっており、2016年までにECBの目標である2%をやや下回る水準となる見込みは低いと考えられている。

②EU統計局が発表した6月のユーロ圏失業率は11.5%と、5月の11.6%から低下となり、債務危機や過去最長のリセッションから回復の兆しが見え始めている。ただ、依然として過去最悪の12%に近い水準に位置している。EU28カ国の失業率は10.2% (10.3%)。主要国ではドイツが5.1% (前月5.1%)、フランスは10.2% (10.1%)、イタリアは12.3% (12.6%)、スペイン24.5% (24.7%)、スウェーデンは8.0% (8.0%)、ポルトガルは14.1% (14.3%)、オーストリアで5.0% (4.9%)、ギリシャは4月時点で27.3% (3月27.3%)だった。

1:45

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、11.33億ドルの米長期国債の買い取りを実施した。

3:45

NY金は、中心限月が前日比14.10ドル安の1オンス=1282.80ドルで取引を終了した。

4:50

NY原油は、中心限月が前日比2.10ドル安の1バレル=98.17ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1282.80	-14.10
NY 原油	98.17	-2.10

(出所:SBILM)

◀ NY 金市場 ▶

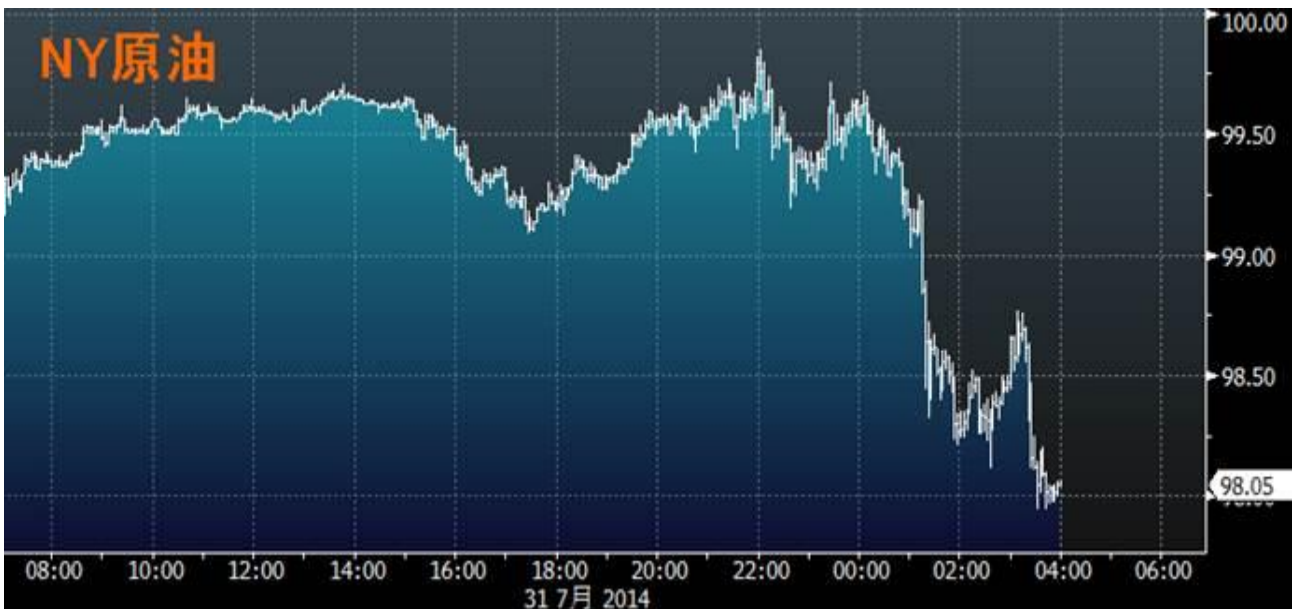
NY 金は、米雇用関連の経済指標が堅調な回復基調を示したことから、比較的安全な資産とされる金の需要が減少するとの見方が広がり、売りが優勢となった。終値ベースでは、6月中旬以来、約1ヵ月半ぶりの安値水準となった。



(出所:ブルームバーグ)

◀ NY 原油市場 ▶

NY 原油は、米中西部カンザス州の火災による製油所の閉鎖が長期化するとの見通しから、製油に必要な原油の需要が落ち込み、在庫がだぶつくとの懸念が広がり、売りが優勢となった。また、米国株が大幅下落となったことも圧迫要因となった。終値ベースでは、3月中旬以来、約4ヵ月半ぶりの安値水準となった。



(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	16563.30	-317.06	16869.63	16563.30
S&P500 種	1930.67	-39.40	1965.14	1930.67
ナスダック	4369.77	-93.13	4430.80	4367.15

(出所:SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、ポルトガルの銀行大手の経営不安や、ウクライナ情勢への懸念を背景に、欧州主要市場の株価が軒並み下落したのを受けて、主要株価は序盤から軟調な動きとなった。また、アルゼンチンの債務問題をめぐる協議が決裂したことも懸念材料となり、主要株価は大幅な下落となった。ダウ平均株価は、序盤から軟調な動きとなり、前日比で 317 ドル安まで下落して引けた。



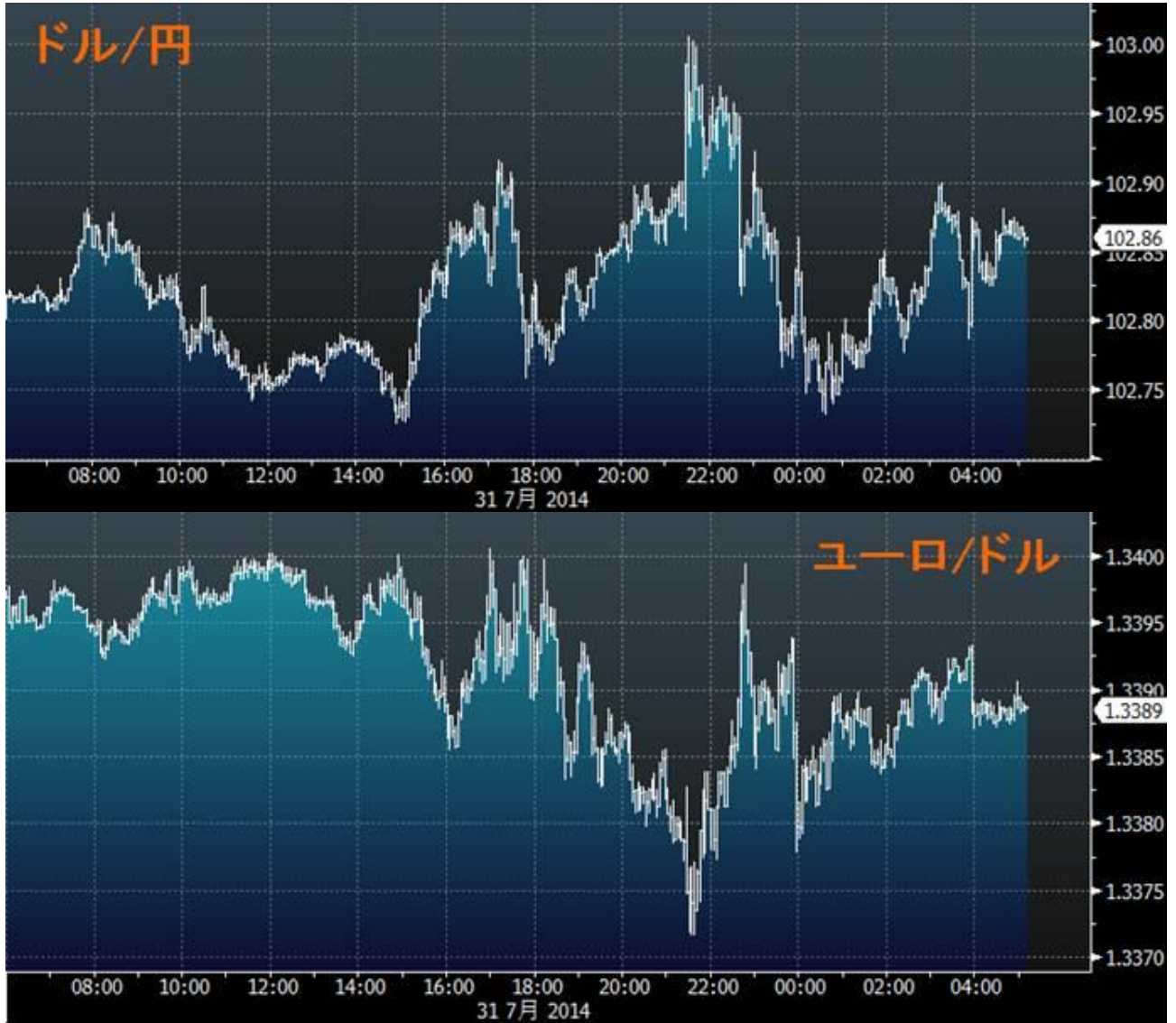
(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	102.85	103.00	102.74
EUR/JPY	137.69	137.82	137.51
GBP/JPY	173.64	173.78	173.46
AUD/JPY	95.55	95.70	95.52
NZD/JPY	87.36	87.44	87.15
EUR/USD	1.3387	1.3400	1.3371
AUD/USD	0.9291	0.9308	0.9279

(出所:SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、序盤は米雇用関連の経済指標が堅調な結果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、アルゼンチンのデフォルトの影響で欧米の株価が大きく下落したことや、米製造業関連の経済指標が予想以上に低下したことを受けて、投資家のリスク回避の動きが強まり、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。ただ、終盤には値を戻す動きも見られた。



(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。