

NY マーケットレポート (2014年8月7日)

NY 市場では、米失業保険申請件数が市場予想より良好な内容となったことを受けて、米景気の先行き期待からドル買い・円売りが先行し、ドル円・クロス円は小動きながら堅調な動きとなった。また、堅調な株価動向も支援材料となった。しかし、ウクライナ東部で戦闘機が撃墜されたとの報道など、ウクライナ情勢の緊迫化を背景に、リスク回避の動きが強まったことから、安全資産とされる円を買う動きが優勢となり、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。また、ホワイトハウスがイラク空爆を検討との報道も圧迫要因となった。一方、ドラギ ECB 総裁が、会見での発言が予想されたほどハト派的ではなかったものの、「マイナス金利は効果的だった」との発言や、「ユーロのショートポジションが大幅に増加した」との発言を受けて、ユーロは主要通貨に対して下落する動きとなった。

2014/ 8/7 (木)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	102.30	102.47	101.04
EUR/JPY	136.77	137.12	136.58
GBP/JPY	172.25	172.63	172.01
AUD/JPY	94.78	95.55	94.70
EUR/USD	1.3373	1.3392	1.3370

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	102.37	102.21
EUR/JPY	136.92	136.69
GBP/JPY	172.47	172.21
AUD/JPY	94.89	94.78
EUR/USD	1.3382	1.3365

*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	15232.37	+72.58
ハンセン指数	24387.56	-196.57
上海総合	2187.67	-29.80
韓国総合指数	2054.51	-6.22
豪ASX200	5509.01	-2.99
インドSENSEX指数	25589.01	-76.26
シンガポールST指数	3314.22	-6.01

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6597.37	-38.79
仏CAC40	4149.83	-57.31
独DAX	9038.97	-91.07
ST欧州600	326.96	-2.23
西IBEX35指数	10078.60	-167.60
伊FTSE MIB指数	19130.65	-379.19
南ア 全株指数	50674.61	-417.19

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	102.07	102.39	102.00
EUR/JPY	136.38	136.95	136.26
GBP/JPY	171.82	172.37	171.72
AUD/JPY	94.67	94.91	94.58
NZD/JPY	86.57	86.80	86.44
EUR/USD	1.3363	1.3394	1.3337
AUD/USD	0.9275	0.9283	0.9264

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	16368.27	-75.07
S&P500	1909.57	-10.67
NASDAQ	4334.97	-20.08
その他主要株	終値	前日比
トロント総合	15118.43	-83.66
ボルサ指数	44116.15	-309.62
ボベスパ指数	56188.05	-299.13

8/8 経済指標スケジュール

08:50	【日】6月貿易収支・6月経常収支
10:30	【豪】6月住宅ローン約定件数
11:00	【中】7月貿易収支(時間不確定)
13:30	【日】7月企業倒産件数
14:00	【日】7月景気ウォッチャー調査
14:45	【スイス】7月失業率
15:00	【独】6月貿易収支・6月経常収支
15:30	【仏】7月企業センチメント指数
15:45	【仏】6月財政収支
15:45	【仏】6月鉱工業生産
15:45	【仏】6月製造業生産指数
16:00	【トルコ】6月鉱工業生産
16:30	【スウェーデン】6月鉱工業生産
17:30	【英】6月商品貿易収支
21:30	【カナダ】7月失業率
21:30	【カナダ】7月労働参加率
21:30	【カナダ】7月雇用ネット変化率
21:30	【米】2Q単位労働費用
21:30	【米】2Q非農業部門労働生産性
23:00	【米】6月卸売上高
23:00	【米】6月卸売在庫

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1312.50	+4.30
NY 原油	97.34	+0.42
CMEコーン	371.25	-3.00
CBOT 大豆	1078.00	-2.00

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.43%	0.46%
3年債	0.87%	0.91%
5年債	1.60%	1.65%
7年債	2.07%	2.13%
10年債	2.41%	2.47%
30年債	3.23%	3.27%

8/8 主要会議・講演・その他予定

・日銀総裁 定例会見

NY 市場レポート

欧州市場

20 : 45

< 経済指標の結果 >

欧州中銀 政策金利発表 0.15% (予想 0.15%・前回 0.15%)

限界貸出金利 0.40% (予想 0.40%・前回 0.40%)

中銀預金金利 -0.10% (予想 -0.10%・前回 -0.10%)



(出所:ブルームバーグ)

21:00

ドル/円 102.21 ユーロ/円 136.69 ユーロ/ドル 1.3365

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	6631.85	-4.31	ダウ INDEX FUTURE	16422	+27
仏 CAC40	4200.04	-7.10	S&P500 FUTURE	1918.70	+3.90
独 DAX	9152.28	+22.24	NASDAQ FUTURE	3873.25	+4.50

(出所:SBILM)

21:30

◀ 経済指標の結果 ▶

新規失業保険申請件数 28.9万件 (予想 30.4万件・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 251.2万人 (予想 251.2万人・前回 254.2万人)
 前回発表の253.9万人から254.2万人に修正



(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 ▶

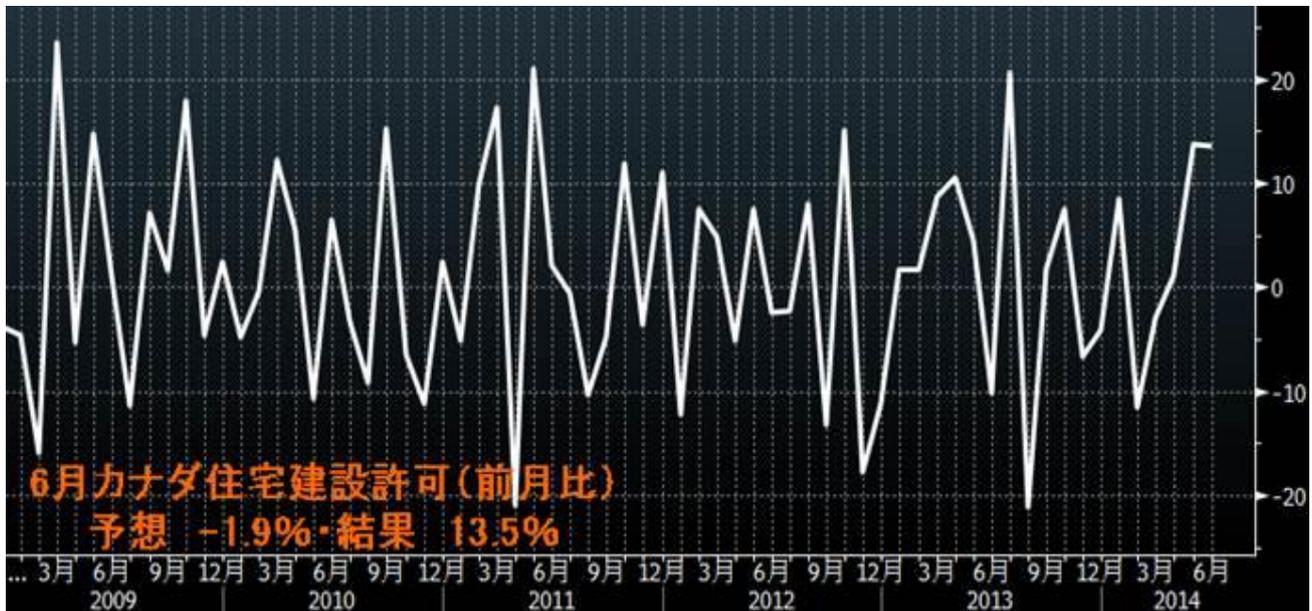
申請件数	前週比	4週移動平均	受給者数	受給者比率
14/08/02	-14,000	293,500	*****	*****
14/07/26	+24,000	297,500	2,518,000	1.9%
14/07/19	-24,000	300,750	2,542,000	1.9%
14/07/12	-2,000	309,250	2,508,000	1.9%
14/07/05	-11,000	312,000	2,508,000	1.9%
14/06/28	+3,000	315,250	2,586,000	2.0%
14/06/21	-1,000	314,500	2,575,000	2.0%
14/06/14	-4,000	312,250	2,568,000	2.0%
14/06/07	+5,000	315,500	2,559,000	1.9%

受給者数は集計が1週間遅れる

21 : 30

◀ 経済指標の結果 ▶

6月カナダ住宅建設許可(前月比) 13.5% (予想 -1.9%・前回 13.8%)
 前回発表の13.8%から15.4%に修正



(出所:ブルームバーグ)

21 : 40

◀ 要人発言 ▶

ドラギ ECB 総裁～定例会見

- ・「政策金利は長期にわたり現行水準に」
- ・「非伝統的な手段のコミットメントで委員会は全会一致」
- ・「ユーロ圏は緩やかな景気回復が続く」
- ・「経済見通しに下向きリスク」

- ・「インフレ率は向こう数カ月低い-15、16年に上昇へ」
- ・「インフレへのリスクは限定的、おおむね均衡」
- ・「ECBは地政学上と為替の影響を注視する」
- ・「理事会は、低インフレが長期化するリスクに対応するため必要なら非標準的措置を活用する決意で一致」

- ・「地政学リスクの高まりや新興国・金融市場の動向は経済に悪影響を及ぼす要因」
- ・「前年比の物価上昇率は今後数カ月低水準にとどまる見込み」
- ・「中長期的なインフレ期待は引き続きわれわれの目標に沿う見込み」
- ・「TLTROは緩和的なスタンスを強化する」

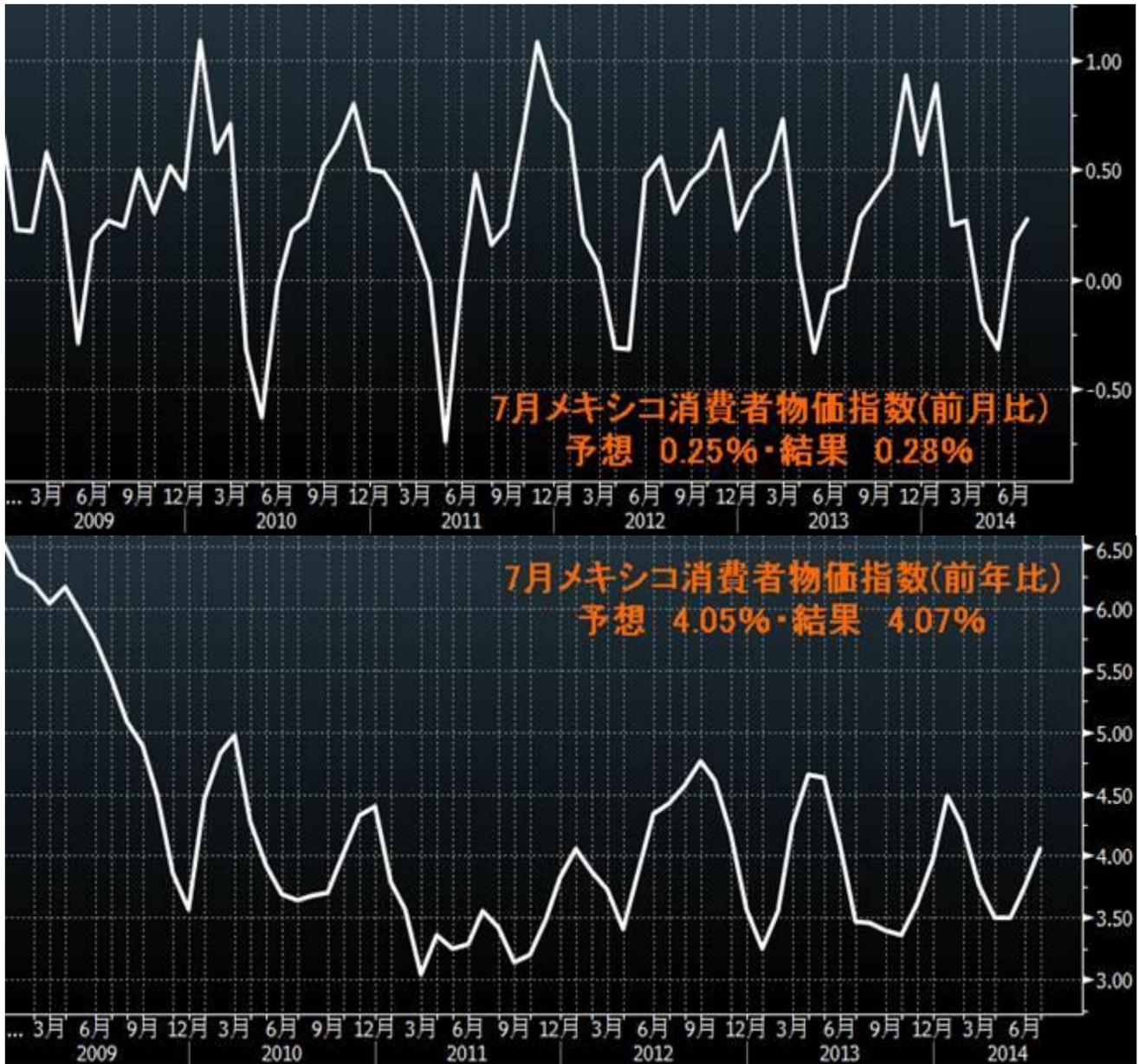
- ・「ABS購入に向けた準備作業を強化し始めた」
- ・「金利は長期にわたり現行水準にとどまる見込み」
- ・「ユーロ圏は緩やかな景気回復が続く」
- ・「景気回復は弱く、脆弱でまだら模様」

22 : 00

< 経済指標の結果 >

7月メキシコ消費者物価指数(前月比) 0.28% (予想 0.25%・前回 0.17%)

7月メキシコ消費者物価指数(前年比) 4.07% (予想 4.05%・前回 3.75%)



(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、米週間失業保険申請件数が市場予想より少なかったことから、米景気の先行き期待でドルを買って円を売る動きが優勢となった。しかし、上値は限定的となった。

22 : 10

◀ 要人発言 ▶

ドラギ ECB 総裁～定例会見

- ・「回復は依然脆弱」
- ・「最新のデータは成長の勢いが弱まっていることを示す」
- ・「マネー・信用の動きは依然弱い、かつてほど悪くはない」
- ・「長期のインフレ期待は変わらないが短期のインフレ期待の低下がみられる」
- ・「6月に発表した措置、特にマイナス金利は効果的だった」
- ・「われわれの金融の状況は米国とは異なる」
- ・「ユーロのショートポジションが大幅に増加」

22 : 33

米主要株価

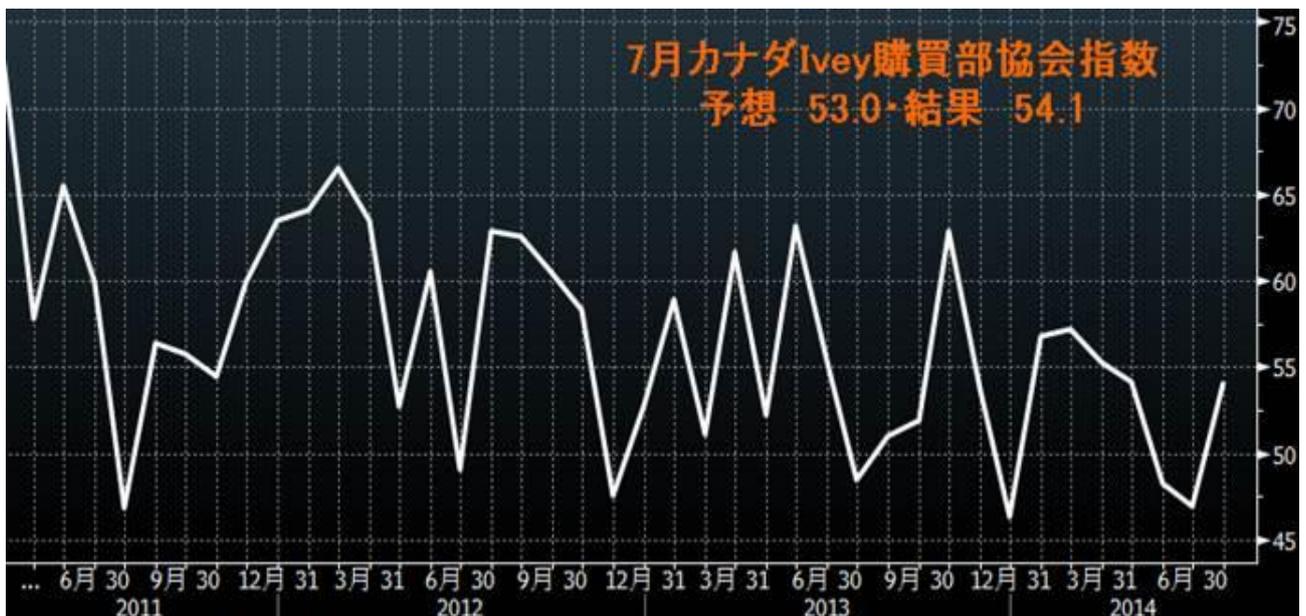
米主要株	株価	前日比
ダウ平均	16496.13	+52.79
ナスダック	4372.27	+17.22

(出所:SBILM)

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

7月カナダ Ivey 購買部協会指数 54.1 (予想 53.0・前回 46.9)



(出所:ブルームバーグ)



(出所: ネットダニアー)

《ポイント》

今回のドラギ総裁の定例会見は、ハト派的な発言が期待されていたものの、やや中途半端な内容となった印象。ユーロ圏やドイツなどの経済指標の悪化が見られる中で、「経済の回復は弱く、脆弱でまだら模様」としたものの、いつものような追加措置の可能性に関する発言はなかった。

ただ、「マイナス金利は効果的だった」や、「ユーロのショートポジションが大幅に増加」と発言したことがユーロ売りを誘う結果となり、ユーロは主要通貨に対して軟調な動きとなった。今回の会見から、ECBは当面新たな措置を取る用意はなく、引き続き効果を見極めるための静観姿勢の継続なのだろう。

23:35

《 NY 株式市場 序盤 》

序盤の株式市場は、米週間失業保険申請件数が市場予想を下回ったことで、労働市場に対する先行き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。ただ、ウクライナ情勢をめぐりロシアと欧米の対立が高まっていることを嫌気した売りも出るなど、やや上値の重い動きも見られている。

《 経済指標のポイント 》

米失業保険申請件数は、前週比-1.4万人の28.9万人と、市場予想の30.5万人を下回る結果となった。申請件数の4週移動平均は、前週比-0.4万人の29万3500人で、2006年2月25日までの週以来の約8年5ヵ月ぶりの少なさとなった。集計が1週遅れる失業保険継続受給者数は、前週比-2.4万人の251.8万人となった。受給者数の4週移動平均は、前週比-1.7万人の251.9万で2007年7月7日までの週以来の低い水準となった。受給者比率は、前週から横ばいの1.9%となった。

0:45

《 要人発言 》

ウクライナ軍のリシェンコ報道官

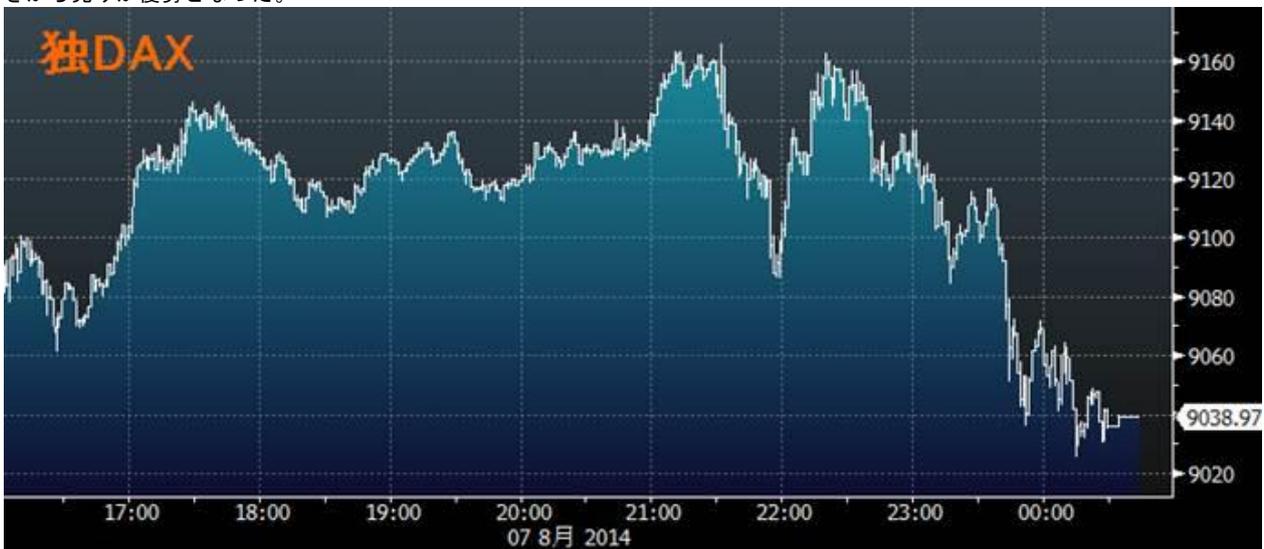
- ・「親口派の標的はラルナカ行きアエロフロート機だった」
- ・「アエロフロート機狙った親口派はマレーシア機を撃墜」
- ・「親口派はロシアの侵攻を促すため航空機攻撃を計画」

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6597.37	-38.79
仏 CAC40	4149.83	-57.31
独 DAX	9038.97	-91.07
ストック欧州 600 指数	326.96	-2.23
ユーロファースト 300 指数	1314.27	-11.52
スペイン IBEX35 指数	10078.60	-167.60
イタリア FTSE MIB 指数	19130.65	-379.19
南ア アフリカ全株指数	50674.61	-417.19

(出所:SBILM)

＜欧州株式市場＞

欧州株式市場は、ウクライナをめぐる欧米とロシアの対立が欧州経済に悪影響を及ぼすとの懸念を背景に、リスク回避姿勢の動きから売りが優勢となった。



(出所:ブルームバーグ)

1:00

米主要株価・中盤

ダウ 16396.88 (-46.46)、S&P500 1917.00 (-3.24) ナスダック 4348.19 (-6.86)

1:10

ウクライナ東部で戦闘機が撃墜されたとの報道



(出所:ネットダンナー)

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、ウクライナをめぐるロシアと欧米の対立が世界経済に悪影響を与えるとの懸念が強まり、安全資産とされる米国債の逃避買いが先行した。米失業保険申請件数が市場予想改善したことから売りが出る場面もあった。

午前の利回りは、30年債が3.25%（前日3.27%）、10年債が2.45%（2.47%）、7年債が2.11%（2.12%）、5年債が1.63%（1.64%）、3年債が0.90%（0.90%）、2年債が0.45%（0.46%）。

《 欧州のポイント 》

①ECBは、ユーロ圏18カ国の金融政策を決める理事会を開き、主要政策金利を過去最低の0.15%で据え置いた。据え置きは2ヵ月連続となった。また、限界貸出金利を0.40%、中銀預金金利を-0.10%でそれぞれ据え置いた。6月の理事会で、マイナス金利の導入を決めたが、その後ユーロ高の一服や銀行間市場の金利下落など、一定の効果が出ており、引き続き様子見を決めた。

②英中銀は、政策金利を過去最低の0.50%に据え置き、資産買い入れ枠も3750億ポンド（約64兆6340億円）に据え置いた。速いペースで進む景気回復を定着させる狙いで現行の政策を維持した。英中銀は声明を発表しなかった。議事録は20日公表される予定。

3:30

NY金は、中心限月が前日比4.30ドル高の1オンス=1312.50ドルで取引を終了した。

4:00

《 経済指標の結果 》

6月米消費者信用残高 172.55億USD（予想 186.50億USD・前回 196.42億USD）

4:10

NY原油は、中心限月が前日比0.42ドル高の1バレル=97.34ドルで取引を終了した。

主要商品	終値	前日比
NY GOLD	1312.50	+4.30
NY 原油	97.34	+0.42

（出所：SBILM）

《 NY 金市場 》

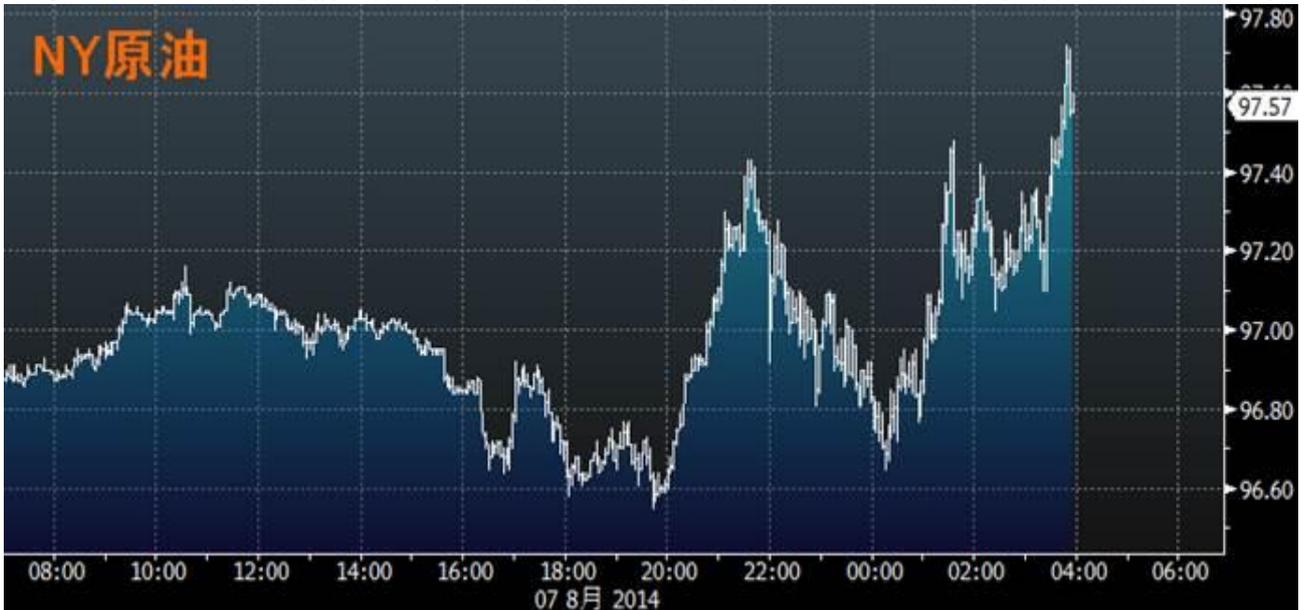
NY金は、ロシアが米国やEUによる経済制裁への報復措置を発表したことで双方の対立が高まっているとの懸念を背景に、比較的安全資産とされる金を買う動きが優勢となった。



（出所：ブルームバーグ）

《 NY 原油市場 》

NY原油は、米オバマ政権がイラク国内の過激派を攻撃するため限定的な空爆を検討していると伝わり、イラク産原油の供給不安が強まったことから買いが優勢となった。また、約半年ぶりの安値水準となったことから、値頃感の買い戻しも入っていた。



(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	16368.27	-75.07	16504.35	16333.78
S&P500種	1909.57	-10.67	1928.89	1904.78
ナスダック	4334.97	-20.08	4379.70	4355.05

(出所:SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、米週間失業保険申請件数が市場予想を下回ったことで、労働市場に対する先行き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。その後は、ウクライナ情勢をめぐりロシアと欧米の対立が高まっていることや、米ホワイトハウスがイラク空爆を検討との報道を受けて、主要株価は軟調な動きとなった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前日比で61ドル高まで上昇したものの、その後は軟調な動きとなり、前日比100ドル安を超える場面もあった。



(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	102.07	102.39	102.00
EUR/JPY	136.38	136.95	136.26
GBP/JPY	171.82	172.37	171.72
AUD/JPY	94.67	94.91	94.58
NZD/JPY	86.57	86.80	86.44
EUR/USD	1.3363	1.3394	1.3337
AUD/USD	0.9275	0.9283	0.9264

(出所: SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、序盤は、米失業保険申請件数が市場予想より良い内容となったことや、堅調な株価動向などを背景にドル円・クロス円は小動きながら堅調な動きとなった。しかし、ウクライナ情勢の緊迫化を背景に、リスク回避の動きが強まり、円が主要通貨に対して堅調な動きとなった。また、ユーロは、ドラギ ECB 総裁の会見を受けて、主要通貨に対して軟調な動きとなった。



(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。