

NY マーケットレポート (2014年8月21日)

NY 市場では、序盤に発表された米失業保険申請件数や、中古住宅販売件数などの経済指標が軒並み市場予想より良好な結果となったことを受けて、発表直後はドルが上昇する場面もあった。しかし、米長期債利回りが低下したことから、日米の金利差縮小が意識され、ドル売り・円買いが優勢となっており、序盤のドル円・クロス円はやや軟調な動きとなった。その後は、堅調な株価動向を背景に、ドル円・クロス円は堅調な動きとなった。ただ、ジャクソンホールでのシンポジウムで、イエレン FRB 議長などの講演を控えて様子見ムードも強まっており、もみ合いの展開が終盤まで続いた。

2014/ 8/21 (木)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	103.84	103.97	103.68
EUR/JPY	137.83	137.84	137.46
GBP/JPY	172.25	172.40	172.00
AUD/JPY	96.29	96.38	96.02
EUR/USD	1.3275	1.3278	1.3242

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	103.91	103.75
EUR/JPY	137.84	137.63
GBP/JPY	172.40	172.08
AUD/JPY	96.40	96.27
EUR/USD	1.3276	1.3258

*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	15586.20	+131.75
ハンセン指数	24994.10	-165.66
上海総合	2230.46	-9.75
韓国総合指数	2044.21	-28.57
豪ASX200	5638.86	+4.26
インドSENSEX指数	26360.11	+45.82
シンガポールST指数	3324.09	+0.44

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6777.66	+22.18
仏CAC40	4292.93	+52.14
独DAX	9401.53	+86.96
ST欧州600	3371.51	+2.21
西IBEX35指数	10556.40	+135.50
伊FTSE MIB指数	20010.51	+404.54
南ア 全株指数	51443.43	+6.84

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	103.86	103.87	103.61
EUR/JPY	137.94	137.94	137.56
GBP/JPY	172.20	172.34	171.89
AUD/JPY	96.60	96.61	96.35
NZD/JPY	87.29	87.29	86.94
EUR/USD	1.3282	1.3289	1.3255
AUD/USD	0.9301	0.9312	0.9277

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17039.49	+60.36
S&P500	1992.38	+5.87
NASDAQ	4532.11	+5.62
その他主要株	終値	前日比
🇨🇦 トロント総合	15556.09	-5.86
🇧🇷 ボルサ指数	45410.36	+162.31
🇲🇽 ボベスパ指数	58992.11	+113.87

8/22 経済指標スケジュール

21:30 【カナダ】6月小売売上高
 21:30 【カナダ】7月消費者物価指数
 22:00 【メキシコ】7月失業率

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1275.40	-19.80
NY 原油	93.96	+0.51
CMEコーン	369.00	+1.50
CBOT 大豆	1038.25	+0.25

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.47%	0.47%
3年債	0.94%	0.94%
5年債	1.63%	1.63%
7年債	2.07%	2.08%
10年債	2.41%	2.43%
30年債	3.19%	3.22%

8/22 主要会議・講演・その他予定

・カンザスシティ連銀 経済シンポジウム
 FRB議長、ECB総裁、日銀総裁講演

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 103.85 ユーロ/円 137.74 ユーロ/ドル 1.3264

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	6773.11	+17.63	ダウ INDEX FUTURE	16987	+37
仏 CAC40	4275.36	+34.57	S&P500 FUTURE	1987.20	+3.90
独 DAX	9371.25	+56.68	NASDAQ FUTURE	4045.25	+5.75

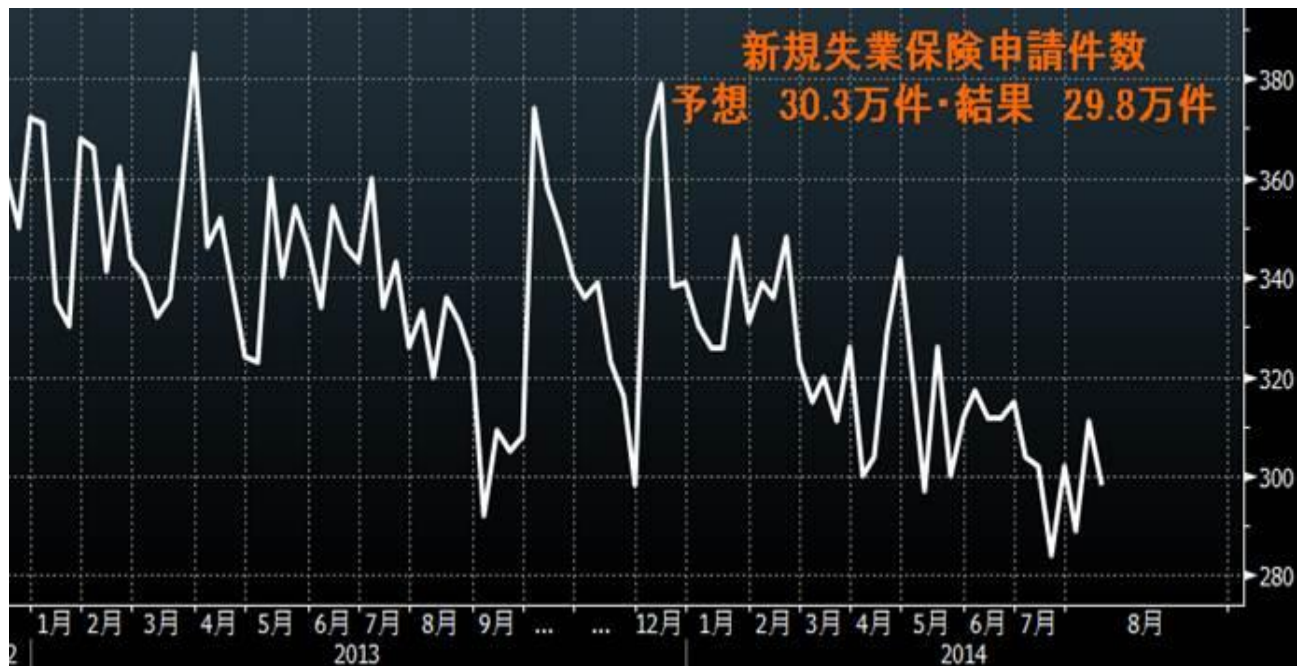
(出所:SBILM)

21:30

< 経済指標の結果 >

新規失業保険申請件数 29.8 万件 (予想 30.3 万件・前回 31.2 万件)
 前回発表の 31.1 万件から 31.2 万件に修正

失業保険継続受給者数 250.0 万人 (予想 252.0 万人・前回 254.9 万人)
 前回発表の 254.4 万人から 254.9 万人に修正



(出所:ブルームバーグ)



(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
14/08/16	298,000	-14,000	300,750	*****	*****
14/08/09	312,000	+22,000	296,000	2,500,000	1.9%
14/08/02	290,000	-13,000	293,750	2,549,000	1.9%
14/07/26	303,000	+24,000	297,500	2,519,000	1.9%
14/07/19	279,000	-24,000	300,750	2,542,000	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%

受給者数は集計が1週間遅れる

22:00

《 経済指標の結果 》

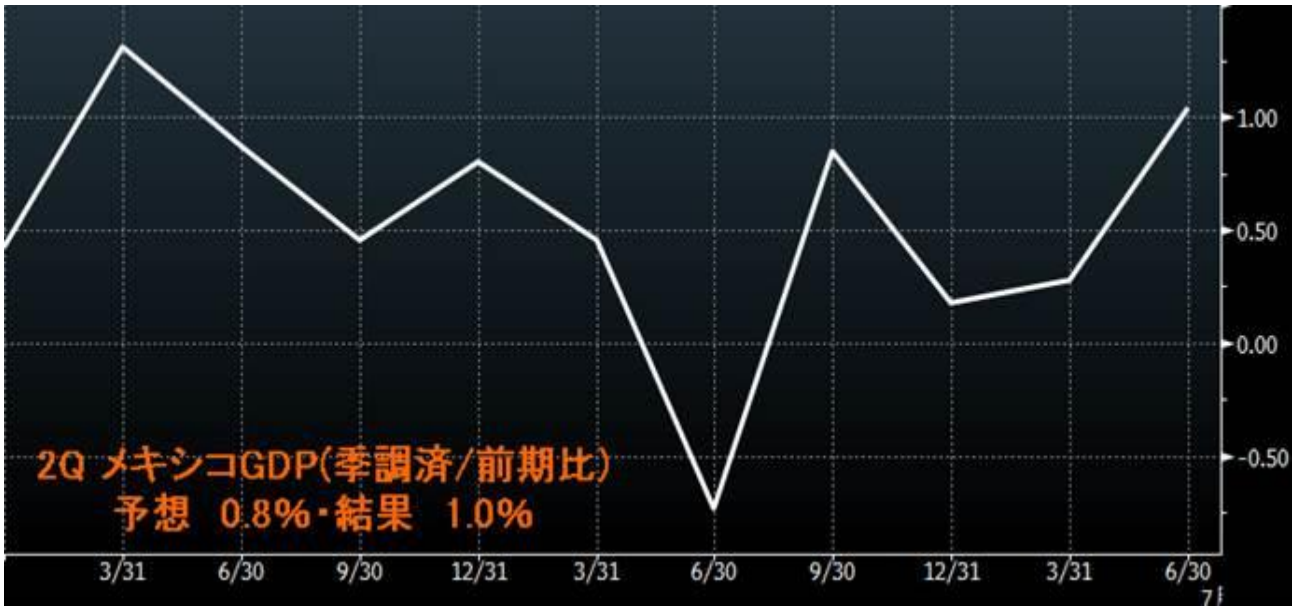
2Q メキシコ GDP(季調前/前年比) 1.6% (予想 1.5%・前回 1.8%)

2Q メキシコ GDP(季調済/前期比) 1.0% (予想 0.8%・前回 0.3%)

6月メキシコ経済活動GAE(前年比) 2.73% (予想 2.50%・前回 1.41%)



(出所:ブルームバーグ)



(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、米失業保険申請件数が市場予想を下回り、ドルを買って円を売る動きが先行した。しかし、イエレンFRB議長の講演を控えて様子見ムードも強く、上値は限定的となった。

22:40

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17001.17	+22.04
ナスダック	4528.37	+1.89

(出所:SBILM)

22:45

《 経済指標の結果 》

マークイット米国製造業PMI 58.0 (予想 55.7・前回 55.8)



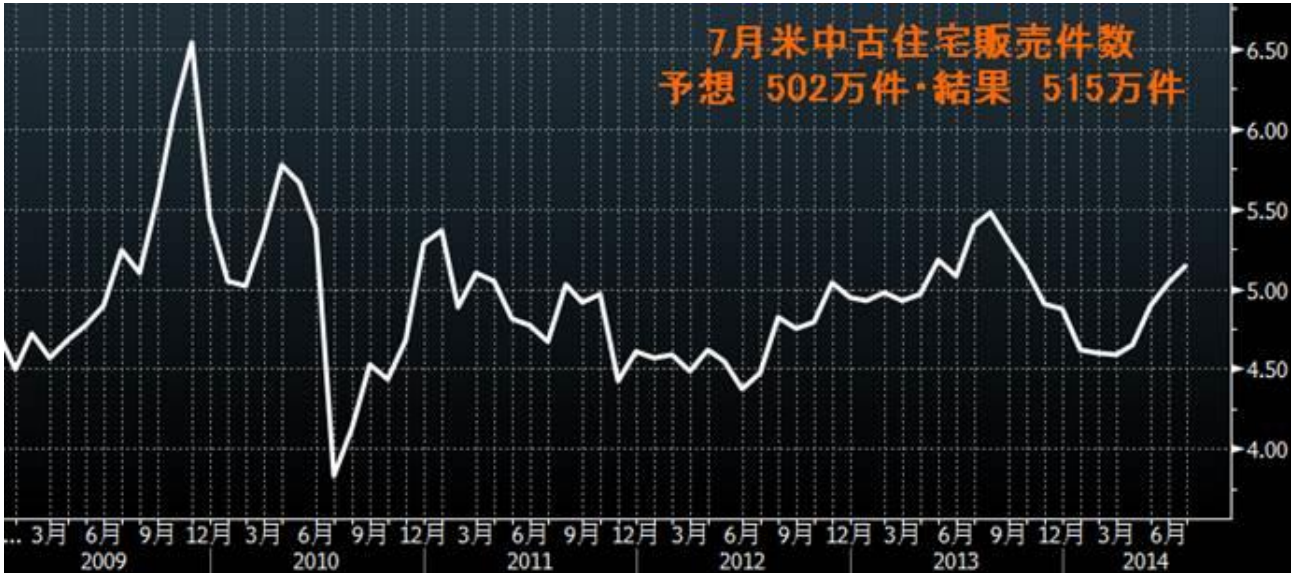
(出所:ブルームバーグ)

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

7月米中古住宅販売件数 515万件（予想 502万件・前回 503万件）
 前回発表 504万件から 503万件に修正

7月米中古住宅販売件数（前月比） 2.4%（予想 -0.4%・前回 2.4%）
 前回発表の 2.6%から 2.4%に修正



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

◀ 中古住宅販売 ▶

	7月	6月	5月	4月	3月	2月
販売戸数	515	503	491	466	459	460
北東部	64	64	62	60	60	55
中西部	122	120	113	104	104	100
南部	212	205	205	194	192	198
西部	117	114	111	108	103	107

(万件)

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

8月フィラデルフィア連銀景況指数 28.0（予想 19.5・前回 23.9）



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

《フィラデルフィア連銀指数》

	8月	7月	6月	5月	4月	3月
景況指数	28.0	23.9	17.8	15.4	16.6	9.0
仕入価格	24.9	34.7	35.0	23.0	11.3	13.9
販売価格	4.2	16.8	14.1	17.0	4.3	4.3
新規受注	14.7	34.2	16.8	10.5	14.8	5.7
出荷	16.5	34.2	15.5	14.2	22.7	5.7
受注残	-4.1	9.1	11.5	-2.5	2.0	2.6
入荷遅滞	4.5	9.6	6.0	-4.2	-14.3	-2.7
在庫水準	8.3	4.8	-6.7	-0.5	-1.5	-6.8
雇用者数	9.1	12.2	11.9	7.8	6.9	1.7

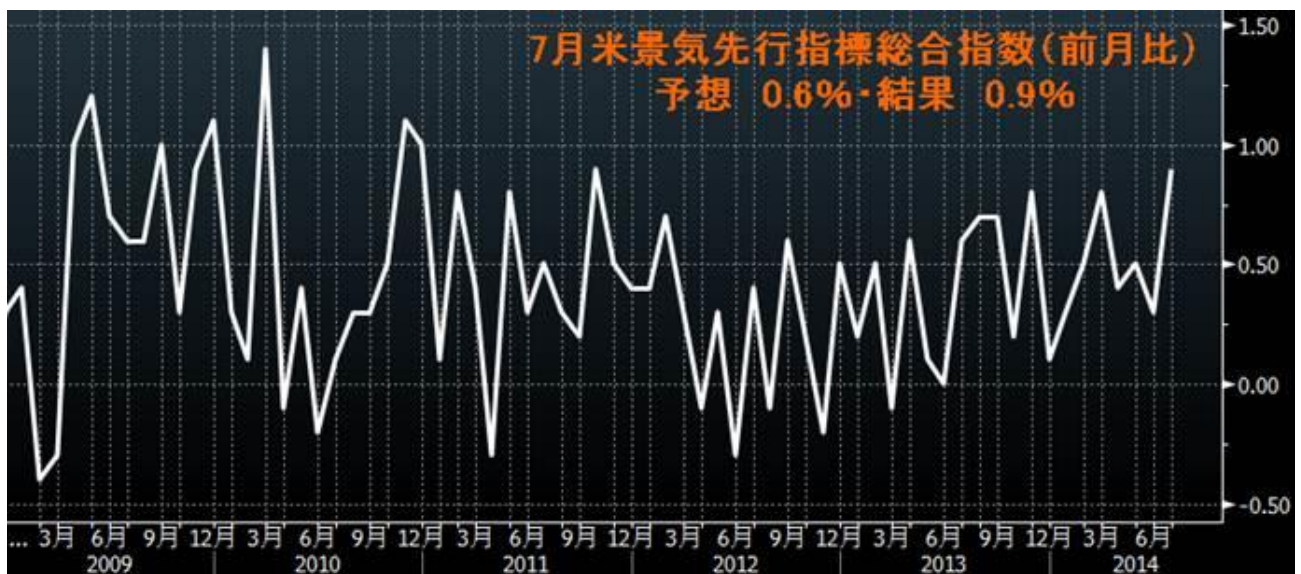
6ヵ月先予想

	8月	7月	6月	5月	4月	3月
景況指数	66.4	58.1	52.0	37.4	26.6	35.4
仕入価格	50.3	38.2	44.5	36.1	35.1	29.4
販売価格	29.5	23.5	30.0	29.5	13.0	15.9
新規受注	58.9	53.5	57.8	36.5	29.7	32.2
出荷	67.4	57.9	48.0	38.7	32.8	41.1
受注残	26.6	13.8	24.7	17.0	1.5	-1.3
入荷遅滞	9.4	4.7	-3.5	3.1	5.7	5.4
在庫水準	10.5	0.5	30.5	15.7	4.8	12.2
雇用者数	24.7	29.1	31.4	24.1	15.9	29.1

23:00

《 経済指標の結果 》

7月米景気先行指標総合指数(前月比) 0.9%(予想 0.6%・前回 0.6%)
 前回発表の0.3%から0.6%に修正



(出所:ブルームバーグ)

指標結果データ

《米景気先行指数》

	7月	6月	5月	4月	3月	2月
先行指数	0.9	0.6	0.6	0.3	1.0	0.5
一致指数	0.2	0.3	0.2	0.2	0.3	0.4
遅行指数	0.2	0.5	0.4	0.3	0.7	0.3

23:00

◀ 経済指標の結果 ▶

8月欧州消費者信頼感 -10.0 (予想 -9.1・前回 -8.4)



(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 ▶

8月・7月・6月・5月・4月・3月

ユーロ圏消費者信頼感指数・-10.0・-8.4・-7.5・-7.1・-8.6・-9.3

23:30

◀ NY 株式市場 序盤 ▶

序盤の株式市場は、米失業保険申請件数が雇用の改善傾向を示し、中古住宅販売件数も市場予想を上回ったことを好感して、米経済に対する楽観的な見方が広がり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、一時前日比で77ドル高まで上昇し、7月29日以来の17000ドル台まで上昇している。

◀ 経済指標のポイント ▶

(1) 米失業保険申請件数は、前週比-1.4万件の29.8万件と、市場予想の30.0万件を下回った。申請件数の4週移動平均は、前週比-4750件の30万750人となった。そして、集計が1週遅れる失業保険継続受給者数は、前週比-4.9万人の250.0万人となり、2007年6月16日までの週以来の低い水準となった。受給者総数の4週移動平均は、前週比-0.2万人の252万7500人となった。また、受給者比率は、前週から横ばいの1.9%だった。

(2) NAR (全米不動産業者協会) が発表した7月の中古住宅販売件数は、年率換算で前月比+2.4%の515万件と4ヵ月連続の増加となり、前年同月比では-4.3%となった。

①一戸建て住宅は、前月比+2.7%の455万件、前年同月比では-4.2%。集合住宅は前月比変わらずの60万件、前年同月比では-4.8%となった。

②地域別では、北東部が前月比横ばいの64万件、中西部は+1.7%の122万件、最大市場の南部は+3.4%の212万件、西部は+2.6%の117万件となった。

③市場に出て売れ残った住宅在庫は、7月末時点で前月比+3.5%の237万件、前年同月比では+5.8%。販売に対する在庫比率は5.5ヵ月で前月から横ばいとなった。

④成約物件の中間販売価格は、前年同月比+4.9%の22万2900ドル、平均販売価格は+3.7%の26万8700ドル。

(3) 8月の米製造業購買担当者景気指数の速報値は58.0と市場予想の55.7を上回り、0010年4月以来の高水準となった。生産は60.2(前月59.7)、雇用は54.6(51.2)となった。関係者は、堅調な製造業活動の勢いが第3・四半期を通じ持続していることが示され、米製造業は、景気回復が本格化していることへの自信を強めているようで、今後数ヵ月に向け生産状況が持続的に回復していくことに備える動きが出ていると指摘している。

(4) 8月のフィラデルフィア連銀製造業景況指数は、28.0となり、前月の23.9から上昇した。項目別では仕入れ価格指数が24.9(前月34.7)、新規受注は14.7(34.2)、雇用指数は9.1(12.2)、出荷は16.5(34.2)、在庫は8.3(5)、販売価格は4.2(16.8)、受注残は-4.1(9.1)となった。6ヵ月先の景況感を示す見通し指数は66.4(前月58.1)に上昇した。当該指数は、ゼロが拡大と縮小の判断基準となる。

(5) 欧州委員会が発表した 8月のユーロ圏消費者信頼感指数(速報値)は、-10となり、前月の-8.4、市場予想の-9.1も下回る結果となった。ウクライナなど東欧の政治的緊張の高まりが、脆弱な景気回復を脅かしている。

0:40

◀ 要人発言 ▶

ウィリアムズサンフランシスコ連銀総裁~TVインタビュー

- ・「データ次第で金利はもっと速く上昇も」
- ・「2015年夏が初回利上げとして妥当なタイミング」

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6777.66	+22.18
仏 CAC40	4292.93	+52.14
独 DAX	9401.53	+86.96
ストック欧州 600 指数	337.51	+2.21
ユーロファースト 300 指数	1354.68	+8.66
スペイン IBEX35 指数	10556.40	+135.50
イタリア FTSE MIB 指数	20010.51	+404.54
南ア アフリカ全株指数	51443.43	+6.84

(出所:SBILM)

◀ 欧州株式市場 ▶

欧州株式市場は、序盤から堅調な動きが続き、米失業保険申請件数が市場予想を下回ったことなどが好感され、主要株価は軒並み上昇する動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)

1:00

米主要株価・中盤

ダウ 17045.12 (+65.99) 、S&P500 1991.69 (+5.18) ナスダック 4523.61 (-2.87)

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、イエレンFRB議長が22日に行う予定の講演で、低金利政策を当面続ける方針を示唆するとの観測が広がり、買いがやや先行した。失業保険申請件数や中古住宅販売件数などの米経済指標が軒並み市場予想より良い内容だったものの、影響は限定的だった。

午前の利回りは、30年債が3.20%（前日3.22%）、10年債が2.42%（2.43%）、7年債が2.08%（2.08%）、5年債が1.63%（1.63%）、3年債が0.94%（0.95%）、2年債が0.47%（0.47%）。

《 欧州のポイント 》

- ①英政府統計局が発表した7月の小売売上高指数は、前月比+0.5%となり、衣料品の需要が堅調で前月比低下だった6月から反転した市場予想を上回る伸びとなった。衣料関連は+0.8%、食料品は+0.4%となった。
- ②7月の英財政収支は、7億6400万ポンド（約1320億円）の赤字となった。前年同月は15億7000万ポンドの赤字。政府収入は+3.2%、支出は+1.9%となった。
- ③8月のユーロ圏購買担当者景気指数速報値は、総合指数が52.8となり、7月の53.8から低下し、市場予想の53.4も下回った。ウクライナ危機をめぐる対ロシア制裁の影響を割り引いても、ユーロ圏の経済成長は第2・四半期に急ブレーキがかかったとの指摘も出ている。特に、ドイツとフランス経済の縮小が要因となった。EU加盟国中、ロシアの最大の貿易相手国であるドイツは、総合PMI指数が前月の55.7から54.9に低下した。ただ、ユーロ圏全体としては50を上回り、景況の改善を示した。
- ④ECBは成長を維持しデフレリスクに対応するため、銀行に低コストで資金を供給している。ECBが来年、資産購入を通じた量的緩和（QE）に踏み切る確率は3分の1程度とみられている。7月のユーロ圏の消費者物価指数の速報値は、前年同月比+0.4%となり、伸びは2009年10月以来の低水準となっている上、ECBが危険水準としている1.0%を大幅に下回っている。

2:00

《 米5年物TIPS入札 》

最高落札利回り・・・-0.281%（前回 -0.213%）
 最低落札利回り・・・-4.000%（前回 -0.290%）
 最高利回り落札比率・・・52.23%（前回 99.13%）
 応札倍率・・・2.48倍（前回 2.70倍）
 発行額・・・160億ドル（前回 180ドル）

3:50

NY金は、中心限月が前日比19.80ドル安の1オンス=1275.40ドルで取引を終了した。

4:15

NY原油は、中心限月が前日比0.51ドル高の1バレル=93.96ドルで取引を終了した。

主要商品	終値	前日比
NY GOLD	1275.40	-19.80
NY 原油	93.96	+0.51

（出所：SBILM）

《 NY 金市場 》

NY金は、FOMC議事録で利上げ前倒しへの警戒感が強まったことに加え、雇用や住宅関連などの米経済指標が軒並み市場予想より良い内容だったことから、比較的 안전한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、5営業日続落となった。



（出所：ブルームバーグ）

◀ NY 原油市場 ▶

NY 原油は、米失業保険申請件数や中古住宅販売戸数などの米経済指標が好調だったことを受けて、景気の回復に伴うエネルギー需要の増加期待から買いが優勢となった。



(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	17039.49	+60.36	17074.59	16983.88
S&P500 種	1992.38	+5.87	1994.76	1986.82
ナスダック	4532.11	+5.62	4534.00	4513.81

(出所:SBILM)

◀ 米株式市場 ▶

米株式市場は、米失業保険申請件数が雇用の改善傾向を示し、中古住宅販売件数も市場予想を上回ったことを好感して、米経済に対する楽観的な見方が広がり主要株価は堅調な動きとなった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な展開が続き、終盤には一時前日比で95ドル高まで上昇した。そして、終値ベースでは、7月24日以来の17000ドル台で引けた。



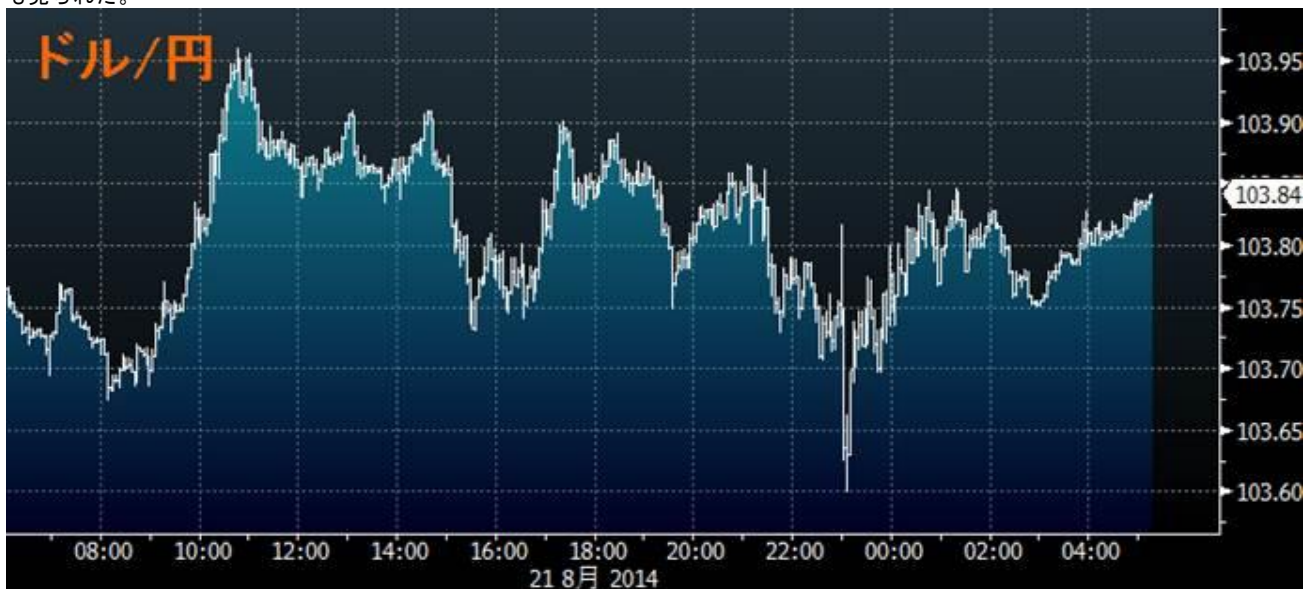
(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	103.86	103.87	103.61
EUR/JPY	137.94	137.94	137.56
GBP/JPY	172.20	172.34	171.89
AUD/JPY	96.60	96.61	96.35
NZD/JPY	87.29	87.29	86.94
EUR/USD	1.3282	1.3289	1.3255
AUD/USD	0.9301	0.9312	0.9277

(出所: SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、米経済指標が堅調な結果となったものの、反応は限定的となり、翌日に控えたイエレン FRB 議長の講演を控えて様子見ムードも強まっており、ドル円・クロス円は小動きの展開が続いた。ただ、堅調な株価動向を背景に、やや堅調な動きも見られた。



(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。