

NY マーケットレポート (2014 年 8 月 25 日)

NY 市場では、序盤に発表されたシカゴ連銀全米活動指数が、市場予想を上回る伸びとなったことを好感し、ドルは大半の主要通貨に対して上昇する動きとなった。また、欧米の株価が堅調な動きとなったことから、ドル円・クロス円は堅調な動きとなった。そして、その後に発表された、米新築住宅販売件数が 2 ヶ月連続のマイナスとなったことから、ドルは一転して上値の重い動きとなった。午後に入ると、新規材料に乏しく、ドル円・クロス円は終盤まで小動きの展開が続いた。

2014/ 8/25 (月)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	104.10	104.28	104.10
EUR/JPY	137.32	137.66	137.30
GBP/JPY	172.49	172.70	172.34
AUD/JPY	97.03	97.12	96.70
EUR/USD	1.3189	1.3208	1.3185

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	104.15	103.87
EUR/JPY	137.38	137.10
GBP/JPY	172.57	172.36
AUD/JPY	97.03	96.75
EUR/USD	1.3205	1.3184

*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	15613.25	+74.06
ハンセン指数	25166.91	+54.68
上海総合	2229.27	-11.54
韓国総合指数	2060.89	+4.19
豪ASX200	5634.88	-10.73
インドSENSEX指数	26437.02	+17.47
シンガポールST指数	3330.28	+4.78

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	休 場	
仏CAC40	4342.11	+89.31
独DAX	9510.14	+170.94
ST欧州600	340.46	+3.71
西IBEX35指数	10690.10	+189.90
伊FTSE MIB指数	20375.39	+457.41
南ア 全株指数	51437.58	+240.42

*英国市場は、Summer Bank Holidayのため休場

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	104.02	104.07	103.87
EUR/JPY	137.24	137.31	137.12
GBP/JPY	172.47	172.59	172.31
AUD/JPY	96.70	96.80	96.61
NZD/JPY	86.79	86.96	86.74
EUR/USD	1.3195	1.3211	1.3190
AUD/USD	0.9297	0.9314	0.9289

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17076.87	+75.65
S&P500	1997.95	+9.55
NASDAQ	4557.35	+18.80
その他主要株	終値	前日比
カナダトロント総合	15598.74	+63.19
ブラジルボルサ指数	45504.34	+129.35
ロシアモスクワ指数	59735.17	+1327.85

8/26 経済指標スケジュール

08:50	【日】8月企業向けサービス価格指数
14:00	【日】8月中小企業景況判断
14:00	【シンガポール】7月鉱工業生産
16:00	【南ア】6月景気先行指数
16:30	【スウェーデン】7月生産者物価指数
17:30	【英】7月BBA住宅ローン承認件数
18:30	【南ア】2Q GDP
21:30	【米】7月耐久財受注
22:00	【米】2Q S&P/ケース・シラー[総合20]
22:00	【米】6月住宅価格指数
23:00	【米】8月リッチモンド連銀製造業指数
23:00	【米】8月消費者信頼感指数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1278.90	-1.30
NY 原油	93.35	-0.31
CMEコーン	367.50	-4.00
CBOT 大豆	1029.25	-12.75

米国債利回り	本 日	前 日
2年債	0.50%	0.49%
3年債	0.98%	0.97%
5年債	1.67%	1.66%
7年債	2.08%	2.09%
10年債	2.38%	2.40%
30年債	3.13%	3.16%

8/26 主要会議・講演・その他予定

・米2年債入札

(出所:SBILM)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 103.95 ユーロ/円 137.21 ユーロ/ドル 1.3200

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	休 場		ダウ INDEX FUTURE	17047	+54
仏 CAC40	4304.64	+51.84	S&P500 FUTURE	1994.70	+6.90
独 DAX	9438.49	+99.32	NASDAQ FUTURE	4070.75	+16.00

* 英国市場は、Summer Bank Holiday のため休場

(出所: SBILM)

21:30

< 経済指標の結果 >

7月シカゴ連銀全米活動指数 0.39 (予想 0.20・前回 0.21)

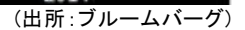
前回発表の 0.12 から 0.21 に修正



(出所: ブルームバーグ)

《 経済指標の結果 》

6月メキシコ小売売上高(前年比) 1.1% (予想 1.3%・前回 1.6%)

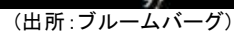


米主要株価

(出所:SBILM)

《 経済指標の結果 》

8月マークイット米国サービス業PMI 58.5 (予想 58.0・前回 60.8)

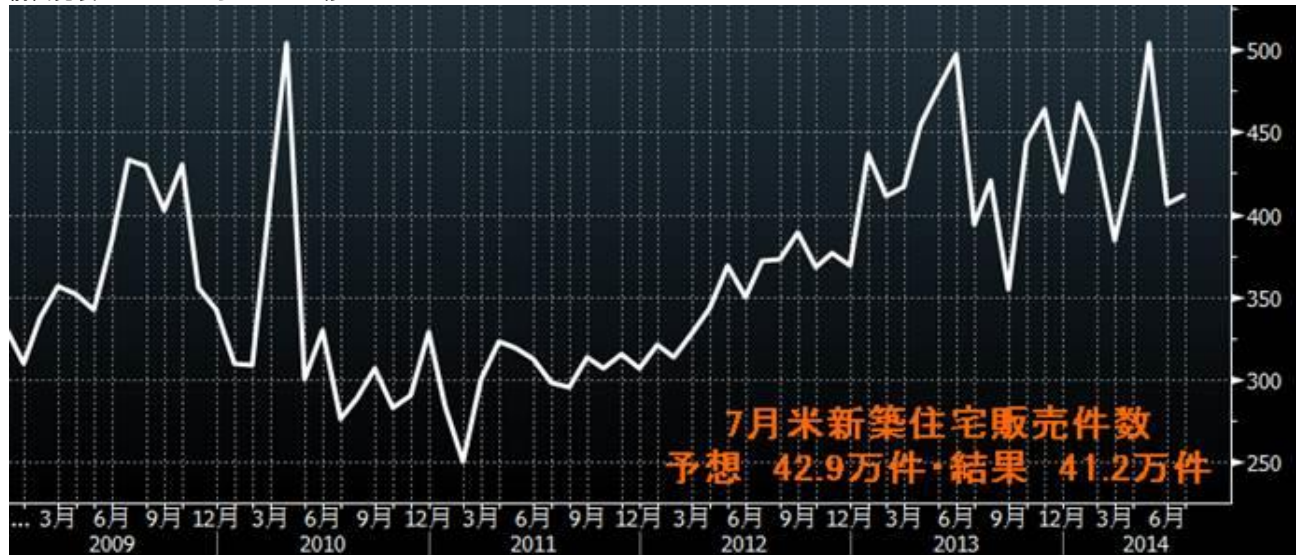


23 : 00

＜ 経済指標の結果 ＞

7月米新築住宅販売件数 41.2万件（予想 42.9万件・前回 42.2万件）
 前回発表の40.6万件から42.2万件に修正

7月米新築住宅販売件数（前月比） -2.4%（予想 5.7%・前回 -7.0%）
 前回発表の-8.1%から-7.0%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 ＞

7月・6月・5月・4月・3月・2月
 販売戸数・41.2・42.2・45.4・41.3・40.3・43.2
 前月比（%）・-2.4・-7.0・9.9・2.5・-6.7・-5.5
 （万件）

7月・6月・5月・4月・3月・2月
 北東部・1.8・2.6・3.6・2.1・2.5・2.3
 中西部・5.2・5.7・7.3・6.5・5.6・5.6
 南部・25.3・23.4・23.6・23.4・23.3・25.9
 西部・8.9・10.5・10.9・9.3・8.9・9.4
 （万件）

23 : 00

＜ 経済指標の結果 ＞

2Qメキシコ経常収支 -69.82億USD（予想 -40億USD・前回 -45.33億USD）



（出所：ブルームバーグ）

23 : 30

<<

経済指標の結果 >>

8月ダラス連銀製造業活動指数 7.1 (予想 12.8・前回 12.7)



(出所:ブルームバーグ)

23 : 50

<< NY 株式市場 序盤 >>

序盤の株式市場は、米金融緩和政策が当面継続するとの見方や、米ファストフード大手の買収交渉が発表されたことを好感して、主要株価は堅調な動きとなっている。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前週末比 110 ドル高まで上昇している。また、S&P500 は、初めて 2000 ポイント台の台座に乗せている。

<< 経済指標のポイント >>

(1) 8月のマークイット米サービス部門 PMI の速報値は、58.5 と市場予想の 59.5 を下回り、2 ヶ月連続の低下となり、5 月以来の低水準となった。担当者は、米サービス部門は引き続き力強い拡大局面にはあるが、6 月に危機前の水準に回復した後、失速の兆候を示していると指摘している。

(2) 7月の米新築住宅販売件数は、年率換算で前月比-2.4%の 41.2 万件と、2 ヶ月連続のマイナスとなった。前年同月比では +12.3%となった。寒波の影響で今年に入り減速感の出ていた新築住宅販売は、5 月には 201 年 4 月まで持ち直したものの、再び伸び悩みが続いている。

①販売を抑制している要因とされる住宅在庫は、7 月末時点で前月比+4.1%の 20.5 万件となり、2010 年 8 月以来 3 年 11 ヶ月ぶりの高水準となった。また、販売に対する在庫比率は 6.0 ヶ月と前月から 0.4 ヶ月上がり、2011 年 10 月以来 2 年 9 ヶ月ぶりに適正とされる水準まで上昇した。

②販売物件の中間価格は、前月比-3.7%の 26 万 9800 ドル、平均価格は前月比+2.1%の 33 万 9100 ドル。

③地域別では、最大市場の南部が+8.1%、北東部が-30.8%、中西部は-8.8%、西部は-15.2%となった。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	休 場	
仏 CAC40	4342.11	+89.31
独 DAX	9510.14	+170.94
ストック欧州 600 指数	340.46	+3.71
ユーロファースト 300 指数	1366.61	+15.23
スペイン IBEX35 指数	10690.10	+189.90
イタリア FTSE MIB 指数	20375.39	+457.41
南ア アフリカ全株指数	51437.58	+240.42

* 英国市場は、Summer Bank Holiday のため休場

(出所:SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、先週末の経済シンポジウムで、ドラギ ECB 総裁が追加緩和の可能性に言及したことや、米国の株価上昇が支援材料となり、主要株価は大幅上昇となった。



(出所:ブルームバーグ)

1 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 17113.86 (+112.64)、S&P500 2001.36 (+12.96) ナスダック 4567.23 (+28.96)

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、ECB が追加緩和に踏み切るとの観測を背景に欧州市場でユーロ圏各国の国債利回りが低下し、相対的に利回りが高い米国債へ資金が流入する一方、今週行われる米国債入札の前にポジション調整の売りが出るなど、もみ合い展開が続いている。

午前の利回りは、30 年債が 3.15% (前週末 3.16%)、10 年債が 2.40% (2.40%)、7 年債が 2.09% (2.09%)、5 年債が 1.68% (1.66%)、3 年債が 0.98% (0.97%)、2 年債が 0.50% (0.49%)。

《欧州のポイント》

①フランスの大統領府の声明によると、パルス首相が 25 日、大統領に内閣総辞職を申し出た。パルス首相は、4 カ月前に内閣を発足させたばかりだった。声明では、新内閣が 26 日に樹立されることになるとしている。世論調査機関によると、今月にパルス首相の支持率は 36%で、最低記録を更新。オランダ大統領も依然として、過去半世紀余りで最も支持率が低い大統領となっている。

②8 月の独 IF0 業況指数は、106.3 と 4 カ月連続で低下となり、2013 年 7 月以来の水準となった。また、4 カ月連続低下はユーロ債務危機だった 2012 年以來となった。ウクライナ危機や対ロシア制裁の影響めぐり、国内企業の間で警戒感が高まっていることが示唆された。ドイツ経済がピークを過ぎたことは間違いない。地政学リスクで国内企業のセンチメントは悪化しているが、様々な紛争がなかったとしても国内経済が一段と成長するのは不可能だったであろうとの指摘もある。IF0 経済研のエコノミストは、ドイツの今年の成長率見通しを現在の 2.0%から 1.5%に引き下げる可能性が高いとし、第 3・四半期の成長率はほぼ横ばいになるとの見解を示した。

③ドイツのメルケル首相は、スペインのデギンドス経済相をユーログループの次期議長として支持する考えを示した。メルケル氏は、スペインのラホイ首相との共同記者会見で、デギンドス氏を「困難な時代の素晴らしい経済大臣」と評した。

3 : 50

NY 金は、中心限月が前週末比 1.30 ドル安の 1 オンス=1278.90 ドルで取引を終了した。

4 : 20

NY 原油は、中心限月が前週末比 0.31 ドル安の 1 バレル=93.35 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1278.90	-1.30
NY 原油	93.35	-0.31A

(出所:SBILM)

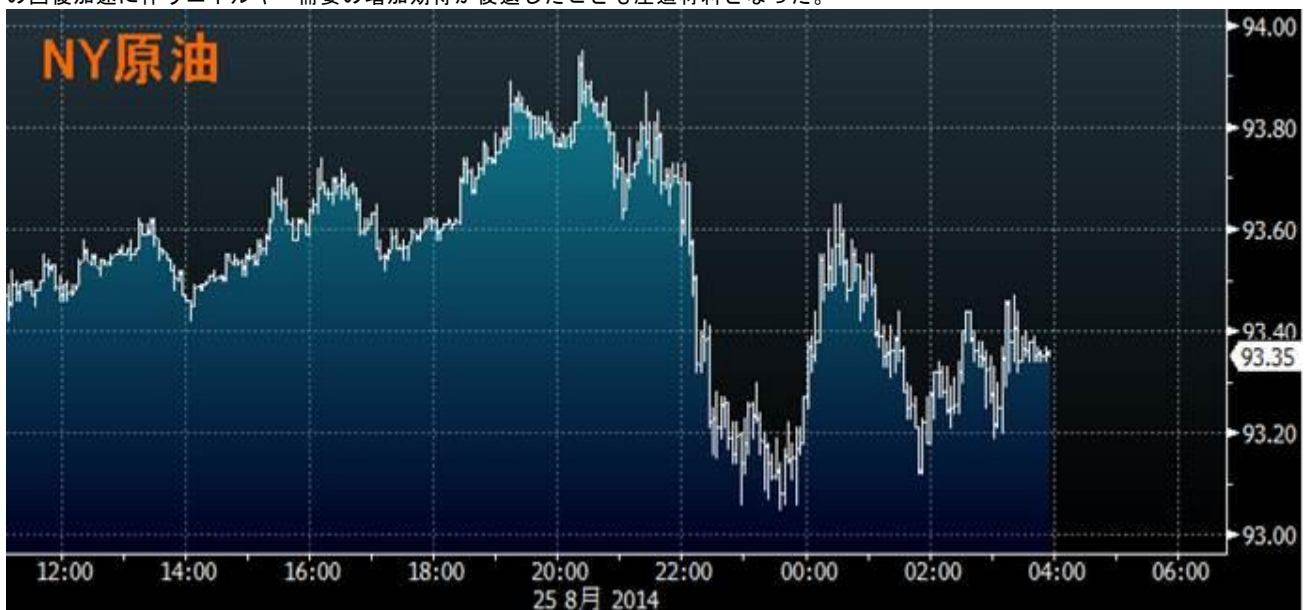
《 NY 金市場 》

NY 金は、ECB が追加金融緩和に踏み切るとの観測を背景に、ユーロ安ドル高が進んだことから、ドル建ての割高感が広がり、売りが優勢となった。また、米国株の上昇で投資家のリスク志向が強まったことも、圧迫材料となった。



《 NY 原油市場 》

NY 原油は、米国の供給過剰感を背景に、売りが優勢となった。また、米新築住宅販売件数が市場予想を下回ったことで、景気の回復加速に伴うエネルギー需要の増加期待が後退したことも圧迫材料となった。



主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	17076.87	+75.65	17124.74	17011.81
S&P500 種	1997.95	+9.55	2001.95	1991.74
ナスダック	4557.35	+18.80	4571.14	4547.78

(出所 SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、米金融緩和政策が当面継続するとの見方や、米ファストフード大手の買収交渉が発表されたことを好感して、主要株価は堅調な動きとなった。また、欧州の主要株価が大きく上昇したことも支援材料となった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前週末比 123 ドル高まで上昇する場面もあった。また、S&P500 は、史上最高値を更新し、初めて 2000 ポイント台の大台に乗せる場面もあったが、終盤にはやや上値の重い動きとなった。



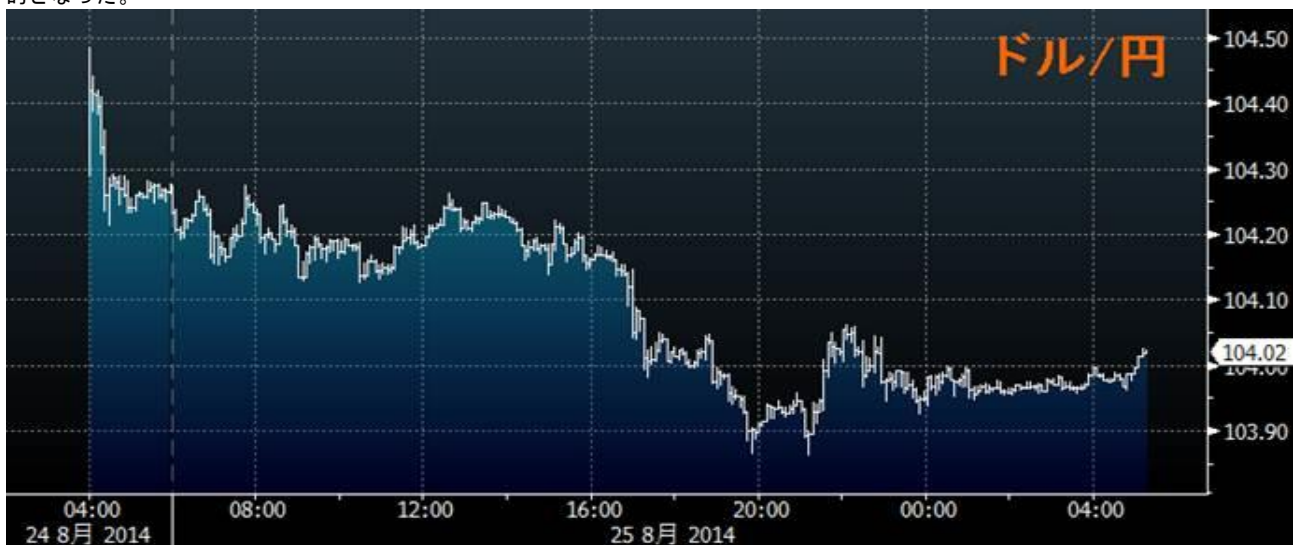
(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	104.02	104.07	103.87
EUR/JPY	137.24	137.31	137.12
GBP/JPY	172.47	172.59	172.31
AUD/JPY	96.70	96.80	96.61
NZD/JPY	86.79	86.96	86.74
EUR/USD	1.3195	1.3211	1.3190
AUD/USD	0.9297	0.9314	0.9289

(出所:SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、欧米の株価が堅調な動き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。その後は、米住宅関連の経済指標が予想を下回る結果となり、ドルがやや軟調な動きとなったものの、その後は新規材料に乏しく、値動きは限定的となった。



(出所:ブルームバーグ)



(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、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。