

NY マーケットレポート (2015 年 2 月 3 日)

NY 市場では、ギリシャ政府がユーロ圏諸国への債務減免要請を撤回したとの報道を受けて、不安視されていたユーロ圏に対する楽観的な見方が広がり、ユーロが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も加わり、投資家のリスク回避の動きから円を売る動きが強まり、ドル円・クロス円は堅調な動きとなった。ただ、米製造業受注が 5 カ月連続でマイナスとなったことや、金融当局者の発言を受けて、FRB が年央までに利上げを開始するとの見方が後退し、ドルは主要通貨に対して軟調な動きとなった。一方、原油価格が 4 営業日続伸となったことから、ブラジル・レアルやノルウェー・クローネなど資源輸出国の通貨は堅調な動きとなった。

2015/2/3 (火)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	117.23	117.71	116.88
EUR/JPY	132.83	133.45	132.39
GBP/JPY	175.84	176.97	175.51
AUD/JPY	89.50	91.83	89.37
EUR/USD	1.1325	1.1352	1.1322

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	117.55	117.17
EUR/JPY	133.45	132.66
GBP/JPY	177.02	175.74
GBP/JPY	90.26	89.41
EUR/USD	1.1358	1.1312

*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	17335.85	-222.19
ハンセン指数	24554.78	+70.04
上海総合	3204.91	+76.61
韓国総合指数	1951.96	-0.72
豪ASX200	5707.37	+82.03
インドSENSEX指数	29000.14	-122.13
シンガポールST指数	3408.02	-15.33

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6871.80	+89.25
仏CAC40	4677.90	+50.23
独DAX	10890.95	+62.95
ST欧州600	370.28	+3.00
西IBEX35指数	10598.20	+270.10
伊FTSE MIB指数	21011.55	+525.86
南ア 全株指数	51949.33	+554.78

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	117.56	117.75	117.22
EUR/JPY	135.01	135.19	133.04
GBP/JPY	178.24	178.41	176.79
AUD/JPY	91.65	92.01	90.04
NZD/JPY	86.66	87.20	84.64
EUR/USD	1.1485	1.1534	1.1341
AUD/USD	0.7796	0.7851	0.7675

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17666.40	+305.36
S&P500	2050.03	+29.18
NASDAQ	4727.74	+51.05
その他主要株	終値	前日比
カナダトロント総合	15062.88	+162.41
ブラジルボルサ指数	41572.24	+621.66
ボベスパ指数	48963.66	+1312.93

2/4 経済指標スケジュール

09:01 【英】1月BRC店頭価格指数
10:30 【日】12月毎月勤労統計[現金給与総額]
10:45 【中】1月HSBC非製造業PMI
11:30 【香港】1月購買部景気指数
17:50 ~ 18:30
【仏】【独】【欧】【英】1月非製造業PMI
19:00 【欧】12月小売売上高(前年比)
20:55 【ポーランド】政策金利発表(時間不確定)
21:00 【米】MBA住宅ローン申請指数
22:15 【米】1月ADP雇用統計
0:00 【米】1月ISM非製造業景況指数
0:00 【カナダ】1月Ivey購買部協会指数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1260.30	-16.60
NY 原油	53.05	+3.48
CMEコーン	385.75	+16.00
CBOT 大豆	987.00	+27.50

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.51%	0.47%
3年債	0.84%	0.77%
5年債	1.29%	1.19%
7年債	1.61%	1.50%
10年債	1.79%	1.68%
30年債	2.38%	2.26%

2/4 主要会議・講演・その他予定

・クリーブランド連銀総裁 講演

(出所: SBILM)

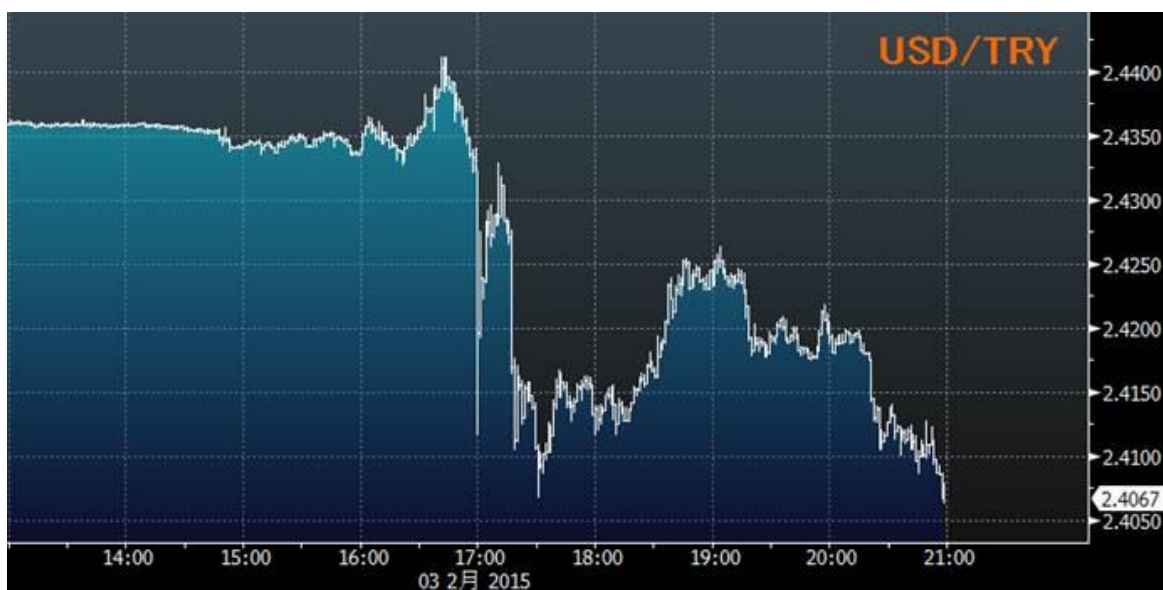
NY 市場レポート

欧州タイム

《ポイント》

トルコ統計局が発表した1月の消費者物価指数は、前月比+1.1%となり、市場予想の+0.7%を大幅に上回る結果となった。前年比では+7.24%と市場予想+6.80%を上回った。1月の生産者物価指数は、前月比+0.33%、前年比+3.28%となった。消費者物価指数が市場予想を上回り、尚且つ中銀総裁が指摘していた+1.0%を上回ったことから、中銀の早期利下げ観測が後退し、通貨リラは対ドルで一時2.400リラ近辺まで上昇する動きとなった。

バシュチュ・トルコ中銀総裁は、3日発表のインフレ指標が弱ければ、臨時の金融政策会合を開く可能性があるとして述べていた。中銀は、インフレ統計発表後に出した声明で「慎重な金融・流動性政策により」インフレ指標は最近数カ月、改善が続いていると指摘した。



(出所:ブルームバーグ)

22:00

ドル/円 117.36 ユーロ/円 133.16 ユーロ/ドル 1.1350

22:00

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	6857.12	+74.57	ダウ INDEX FUTURE	17331	+32
仏 CAC40	4677.44	+49.77	S&P500 FUTURE	2021.30	+4.20
独 DAX	10929.53	+101.52	NASDAQ FUTURE	4191.75	+6.25

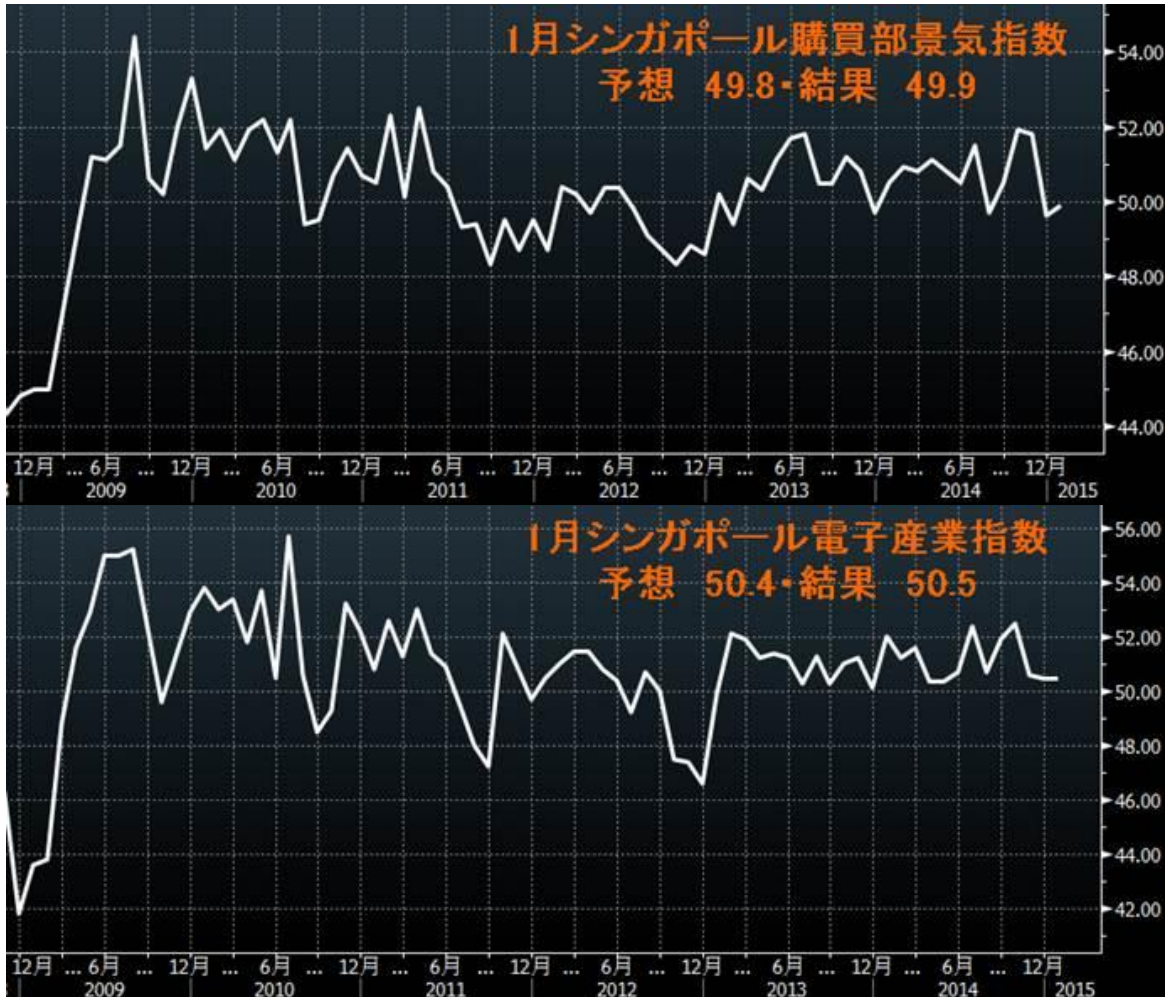
(出所:SBILM)

22 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

1 月シンガポール購買部景気指数 49.9 (予想 49.8・前回 49.6)

1 月シンガポール電子産業指数 50.5 (予想 50.4・前回 50.5)



(出所:ブルームバーグ)

22 : 05

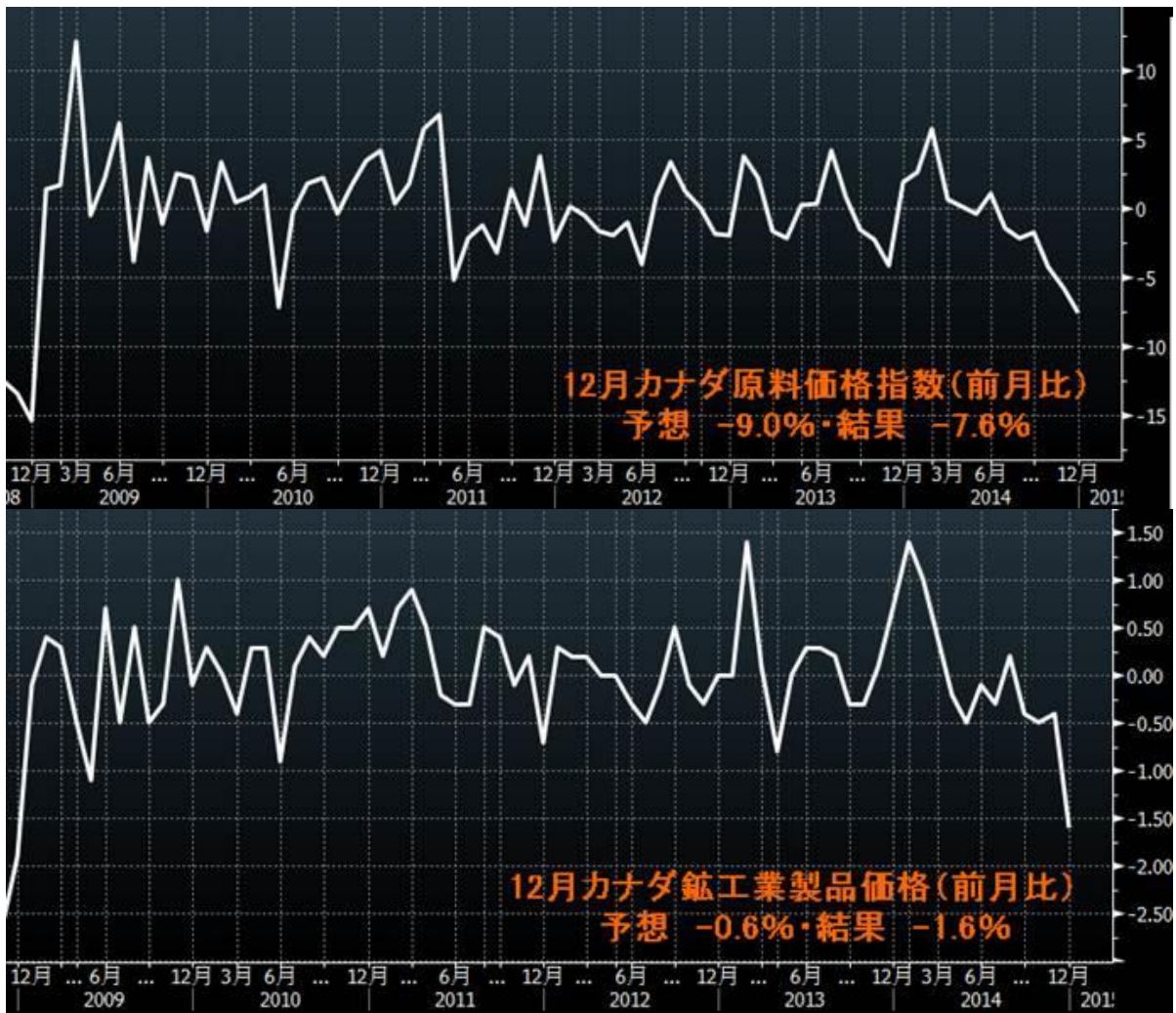
メルケル独首相、ギリシャ資金交渉は、数カ月続く見通し～関係者

22 : 30

◀ 経済指標の結果 ▶

12 月カナダ原料価格指数 (前月比) -7.6% (予想 -9.0%・前回 -5.7%)
前回発表の-5.8%から - 5.7%に修正

12 月カナダ鉱工業製品価格 (前月比) -1.6% (予想 -0.6%・前回 -0.5%)
前回発表の-0.4%から - 0.5%に修正



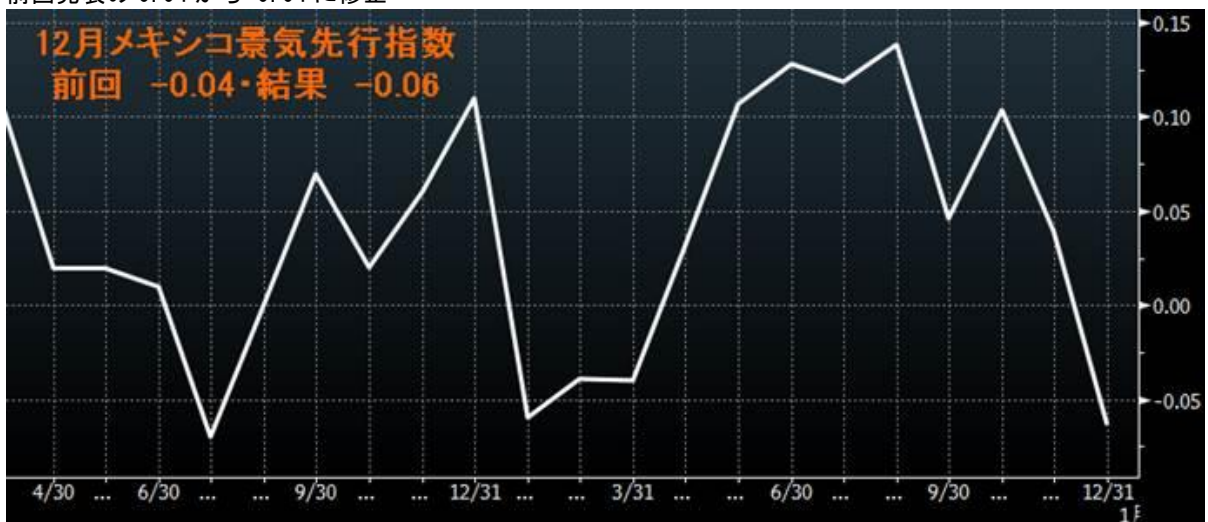
(出所:ブルームバーグ)

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

12月メキシコ景気先行指数 -0.06 (前回 -0.04)

前回発表の 0.04 から-0.04 に修正



(出所:ブルームバーグ)

23 : 33

米主要株価

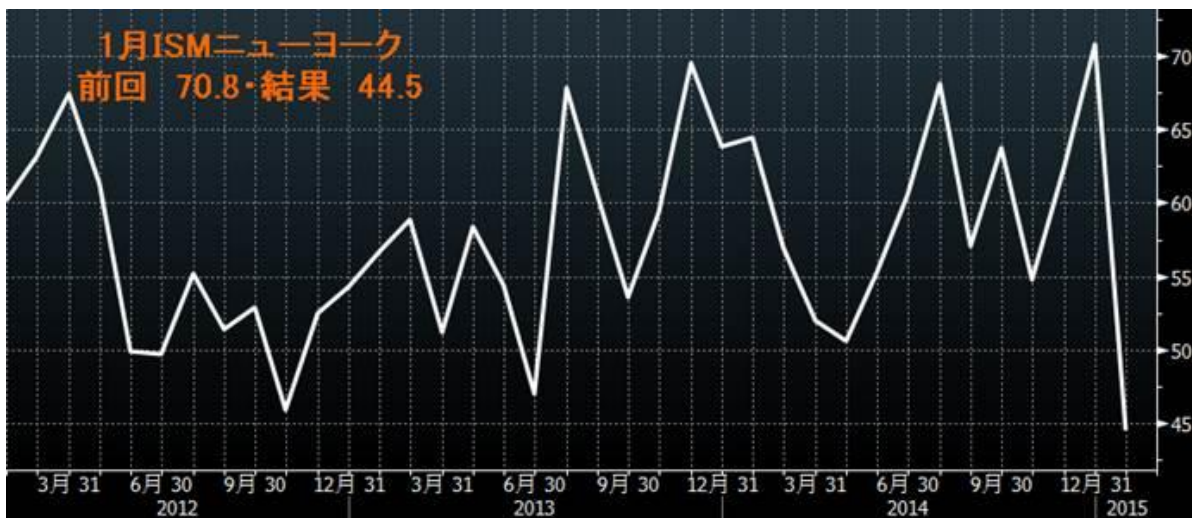
米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17492.75	+131.71
ナスダック	4700.17	+23.48

(出所: SBILM)

23 : 45

《 経済指標の結果 》

1 月 ISM ニューヨーク 44.5 (前回 70.8)



(出所: ブルームバーク)

0 : 00

《 経済指標の結果 》

12 月米製造業受注指数 (前月比) -3.4% (予想 -2.4%・前回 -0.7%)



(出所: ブルームバーク)

指標結果データ

《製造業新規受注指数》

	12月	11月	10月	9月	8月	7月
新規受注	-3.4	-1.7	-0.7	-0.5	-10.0	10.5
輸送機器を除く	-2.3	-1.3	-1.5	0.0	0.0	-0.7
受注残	-0.8	0.0	0.5	0.4	0.6	5.3
耐久財	-3.3	-2.2	0.3	-0.7	-18.3	22.5
輸送機器	-9.1	-4.0	3.5	-3.1	-42.4	73.3

0 : 00

《 要人発言 》

ルー米財務長～下院歳入委員会で証言の事前テキスト

- ・「米経済は、自律的成長の段階に入っている」
- ・「世界は米国だけに依存することはできない」

0 : 20

《 要人発言 》

ブラード・セントルイス連銀総裁～講演

- ・「原油安と長期金利は米国への追い風」
- ・「米経済には大きな勢いがみられる」
- ・「強いドルは米成長見通しを反映」
- ・「ドルは米経済における重大な要素ではない」

0 : 30

《 NY 株式市場 序盤 》

序盤の株式市場は、原油相場が上昇したことで石油関連株が大きく買われ、全体を押し上げている。また、ギリシャの債務問題が解決に向かうとの期待も広がり、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が続いており、一時前日比で 200 ドル高を突破する動きも見られている。

《 経済指標のポイント 》

12 月の米製造業受注は、前月比-3.4%の 4714 億 5400 万ドルと 5 ヶ月連続で減少し、昨年 8 月以来 4 ヶ月ぶりの大きな減少率となった。また、変動の激しい輸送機器を除く受注も-2.3%と 3 ヶ月連続のマイナスとなった。耐久財、非耐久財とも落ち込んだことで、全体を押し下げる結果となった。

①耐久財が-3.3%となり、主力の輸送機器は-9.1%で、特に民間航空機が-55.5%、国防航空機は-13.8%、一般機械が-3.2%と 2013 年 2 月以来の大きな落ち込み、電算機・電子製品も-1.6%となった。一方、自動車・同部品は+1.1%となった。

②資本財は-9.1%となり、国防資本財は-7.9%、国防関連を除く資本財は-9.3%、また民間設備投資の先行指標となるコア資本財は-0.1%となった。

③製造業全体の出荷は-1.1%、受注残高は-0.8%、在庫は-0.3%となり、在庫は 2009 年 9 月以来の大きな減少率となった。また、出荷に対する在庫比率は、前月比+0.01 ポイントの 1.34 となった。

1 : 30

1 月米自動車販売

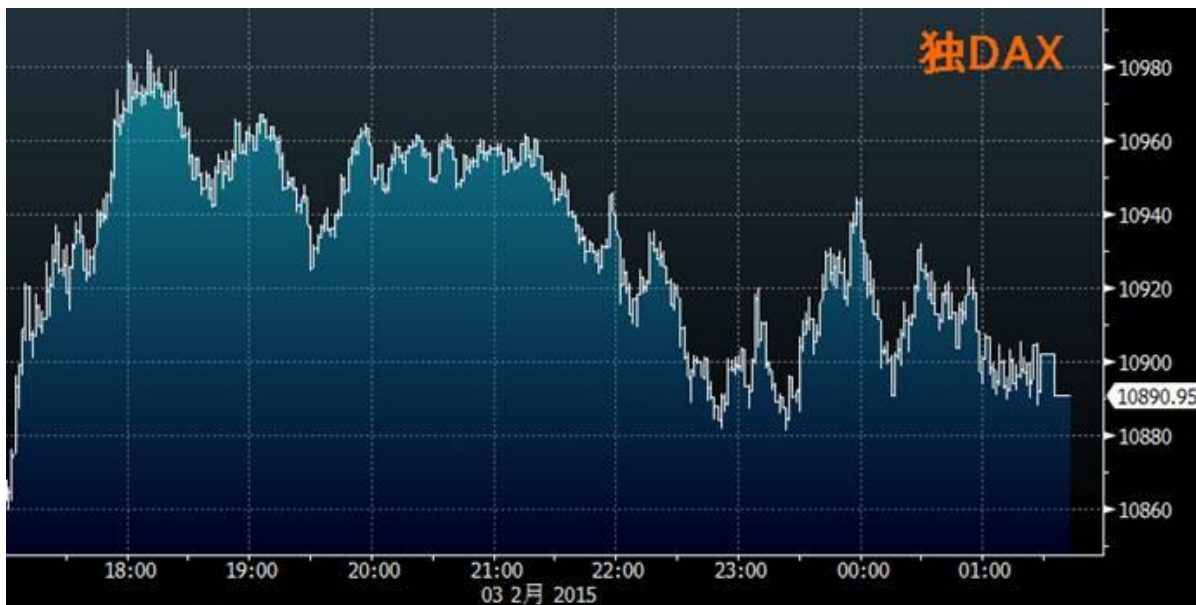
- ・フィアット・クライスラーは+14%（予想+13.8%）
- ・フォードは+15.6%（予想+12.8%）
- ・GMは+18.3%（予想+18.8%）
- ・トヨタは+15.6%（予想+13%）
- ・日産は+15.1%（予想+11.4%）
- ・ホンダは+11.5%（予想+12.6%）

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6871.80	+89.25
仏 CAC40	4677.90	+50.23
独 DAX	10890.95	+62.95
ストック欧州 600 指数	370.28	+3.00
ユーロファースト 300 指数	1478.80	+11.07
スペイン IBEX35 指数	10598.20	+270.10
イタリア FTSE MIB 指数	21011.55	+525.86
南ア アフリカ全株指数	51949.33	+554.78

（出所：SBILM）

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、ギリシャの債務交渉の進展を期待した買いが広がり、主要株価は堅調な動きとなった。また、英 FT100 は、原油価格が上昇したことを好感して石油関連株が上昇となり、全体を押し上げた。



（出所：ブルームバーグ）

2 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 17489.99 (+128.95)、 S&P500 2034.52 (+13.67)、 ナスダック 4674.67 (-2.02)

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、ギリシャへの金融支援をめぐる同国の新政権と EU などとの交渉が進展するとの見方を背景に投資家のリスク志向が強まり、安全資産とされる米国債を売る動きが先行した。また、原油価格の上昇で、原油安が世界経済に悪影響を及ぼすとの懸念が後退したことも国債相場を圧迫した。

午前の利回りは、30 年債が 2.32%（前日 2.26%）、10 年債が 1.74%（1.67%）、7 年債が 1.56%（1.49%）、5 年債が 1.24%（1.19%）、3 年債が 0.81%（0.76%）、2 年債が 0.49%（0.47%）。

《 欧州のポイント 》

①ギリシャ紙は、ギリシャが欧州委員会のモスコビシ委員（経済・財務担当）に対し、必要な資金を賄うため短期証券（T ビル）の発行上限を 100 億ユーロ引き上げるよう求めたと伝えた。ギリシャのバルファキス財務相は、訪問先のパリでモスコビシ委員とサバン仏財務相と会い、現在 150 億ユーロとなっている T ビル発行上限を 250 億ユーロへ引き上げることに同意するよう求めた。

②ギリシャの大手銀 4 行のうち 3 行は、預金の流出で流動性が低下したことから、緊急流動性支援制度を通じてギリシャ中銀から約 20 億ユーロを借り入れたことが、関係筋の話で明らかになった。ECB は、先月 21 日にギリシャの銀行に対する緊急流動性支援制度を承認した。ECB は 4 日に緊急流動性支援制度の状況について見直しを行う予定。

③ECB（欧州中央銀行）は、期間 7 日（2 月 4 日-11 日）の流動性供給入札を実施し、153 行に 1517 億 6800 万ユーロを供給すると明らかにした。

④デンマーク中銀は、1 月に過去最大規模のクローネ売りを実施した。中銀は資本流入を抑えるため 1 月に 3 回の利下げを実施、預金金利を -0.50% としたほか、前例のない政策パッケージを導入している。さらに、1063 億クローネ（約 1 兆 9200 億円）相当の自国通貨売り介入を実施。投機家が中銀の決意を試す中でクローネのユーロ・ペッグを防衛した。これにより、外貨準備は過去最高の 5641 億クローネとなった。

2 : 45

《 要人発言 》

コチャラコタ・ミネアポリス連銀総裁

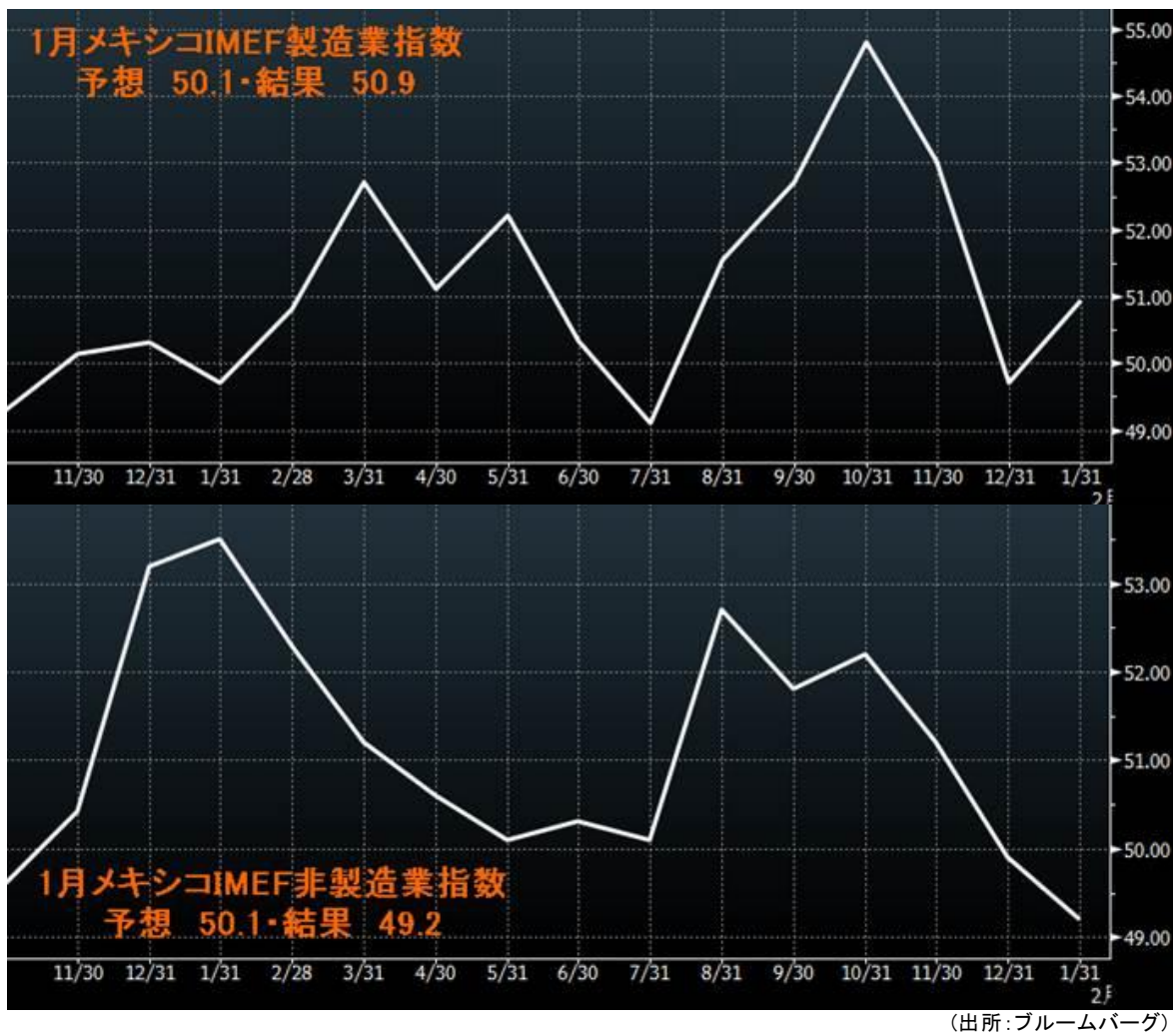
- ・「2015 年中の利上げは、物価回復ペースを緩慢に」
- ・「インフレ率 2% 達成には数年かかる」
- ・「低インフレの長期化は、FRB の信頼性脅かす」

3 : 00

《 経済指標の結果 》

1 月メキシコ IMEF 製造業指数 50.9（予想 50.1・前回 50.1）
前回発表の 49.7 から 50.1 に修正

1 月メキシコ IMEF 非製造業指数 49.2（予想 50.1・前回 49.9）



4 : 50

NY 金は、中心限月が前日比 16.60 ドル安の 1 オンス=1260.30 ドルで取引を終了した。

5 : 10

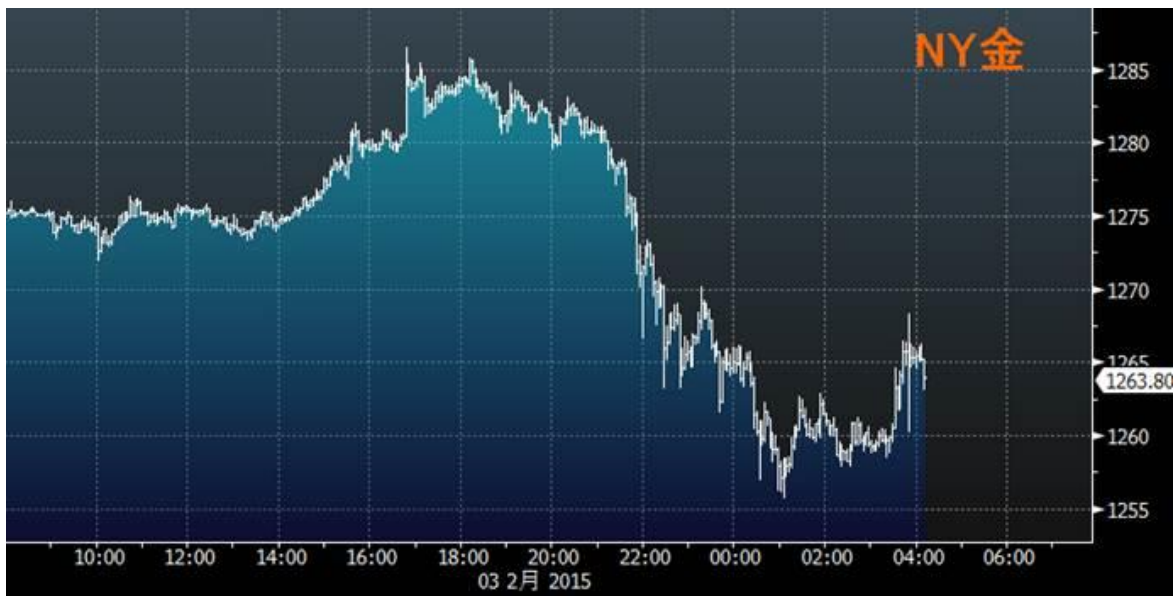
NY 原油は、中心限月が前日比 3.48 ドル高の 1 バレル=53.05 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1260.30	-16.60
NY 原油	53.05	+3.48

(出所:SBILM)

《 NY 金市場 》

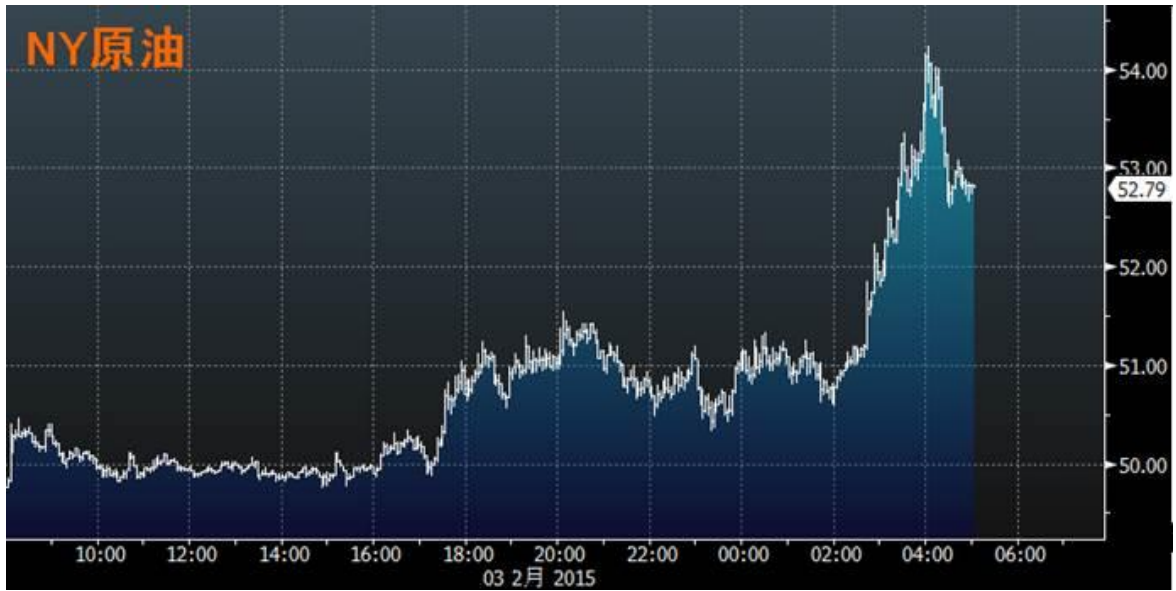
NY 金は、対ギリシャ金融支援をめぐる同国の新政権と EU などの交渉が進むとの期待から投資家のリスク志向が強まり、比較的安全な資産とされる金売って株などに資金を振り向ける動きが広がった。



(出所:ブルームバーグ)

◀ NY 原油市場 ▶

NY原油は、英石油大手が設備投資削減を発表したと伝わり、供給過剰懸念が後退した。また、ドルがユーロなどに対して下落し、ドル建ての原油に割安感が出たことも支援材料となった。終値ベースでは、昨年12月31日以来、約1ヵ月ぶりの高値水準となった。



(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	17666.40	+305.36	17670.70	17369.97
S&P500 種	2050.03	+29.18	2050.30	2022.71
ナスダック	4727.74	+51.05	4727.74	4670.82

(出所:SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、原油価格が大きく上昇したことを受けて、石油関連株が相場を牽引する動きとなった。また、ギリシャの債務問題が解決に向かうとの期待や、米利上げ時期が後退するとの思惑も支援材料となり、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が続き、終盤には前日比で 300 ドル高を突破する動きも見られた。



(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	117.56	117.75	117.22
EUR/JPY	135.01	135.19	133.04
GBP/JPY	178.24	178.41	176.79
AUD/JPY	91.65	92.01	90.04
NZD/JPY	86.66	87.20	84.64
EUR/USD	1.1485	1.1534	1.1341
AUD/USD	0.7796	0.7851	0.7675

(出所:SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、ギリシャの債務交渉が進展するとの期待感や、欧米の株価が大きく上昇したことを受けて、投資家のリスク回避の動きが後退し、ドル円・クロス円は堅調な動きとなった。ただ、ドルは、米国の利上げ時期が再送りされるとの思惑が広がり、主要通貨に対して軟調な展開が続いた。



(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。