

NY マーケットレポート (2015 年 7 月 20 日)

NY 市場では、米国の主要な経済指標の発表がなく、取引材料に乏しい中、全般的に限定的な動きが続いた。序盤には、ブラード・セントルイス連銀総裁が「9 月利上げの可能性は 50% 上回る」と発言したことを受けて、米国の利上げ期待が高まり、米長期債利回りが上昇したことを受けて、ドルが主要通貨に対して堅調な動きとなった。しかし、その後は長期債利回りが低下したことから反落となった。一方、ギリシャが ECB に国債償還に伴う支払い手続きを行い、IMF への債務も返済したことで、ギリシャのユーロ離脱懸念が後退したことを受けて、ユーロは堅調な動きとなった。ただ、その後は方向感に乏しく、やや上値の値動きが続いた。そして、コモディティ価格が軒並み下落したことから、資源国通貨は軟調な動きとなった。

2015/7/20 (月)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	124.17	124.20	124.08
EUR/JPY	134.86	134.87	134.30
GBP/JPY	193.73	193.95	193.52
AUD/JPY	91.76	91.80	91.00
EUR/USD	1.0863	1.0865	1.0820

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	124.38	124.17
EUR/JPY	134.93	134.56
GBP/JPY	193.81	193.06
AUD/JPY	91.77	91.56
EUR/USD	1.0864	1.0826

*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	休 場	
ハンセン指数	25404.81	-10.46
上海総合	3992.11	+34.76
韓国総合指数	2073.31	-3.48
豪ASX200	5686.89	+16.78
インドSENSEX指数	28420.12	-43.19
シンガポールST指数	3373.48	+20.03

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6788.69	+13.61
仏CAC40	5142.49	+18.10
独DAX	11735.72	+62.30
ST欧州600	406.80	+1.12
西IBX35指数	11556.10	+75.40
伊FTSE MIB指数	24031.19	+265.78
南ア 全株指数	52988.32	+264.60

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	124.30	124.38	124.20
EUR/JPY	134.56	135.05	134.56
GBP/JPY	193.49	193.91	193.19
AUD/JPY	91.63	91.81	91.35
NZD/JPY	81.66	81.88	81.39
EUR/USD	1.0827	1.0871	1.0825
AUD/USD	0.7372	0.7391	0.7347

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	18100.41	+13.96
S&P500	2128.28	+1.64
NASDAQ	5218.86	+8.72
その他主要株	終値	前日比
カナダトロント総合	14425.55	-217.29
ブラジルボルサ指数	45567.99	+242.61
ロシアモスクワ指数	51600.08	-741.72

7/21 経済指標スケジュール

08:50 【日】6月日銀金融政策決定会合・議事要旨
 10:30 【豪】7月豪中銀議事録
 14:00 【日】5月景気一致CI指数
 14:00 【日】5月景気先行CI指数
 14:30 【日】6月全国百貨店売上高
 15:00 【スイス】6月貿易収支
 16:00 【スイス】6月マネーサプライM3
 16:00 【南ア】5月景気先行指数
 16:00 【日】6月コンビニエンスストア売上高
 17:30 【英】6月公共部門純借入所要額
 17:30 【英】6月公的部門純借入額
 17:30 【香港】6月消費者物価指数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1106.80	-25.10
NY 原油	50.15	-0.74
CME コーン	416.00	-15.25
CBOT 大豆	999.50	-7.25

米国債利回り	本 日	前 日
2年債	0.70%	0.67%
3年債	1.09%	1.05%
5年債	1.70%	1.67%
7年債	2.11%	2.08%
10年債	2.37%	2.35%
30年債	3.10%	3.08%

7/21 主要会議・講演・その他予定

(出所:SBILM)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 124.23 ユーロ/円 134.74 ユーロ/ドル 1.0847

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	6792.60	+17.52	ダウ 先物ミニ	18026	+29
仏 CAC40	5163.88	+39.49	S&P 500 ミニ	2121.50	+2.75
独 DAX	11785.62	+112.20	NASDAQ 100 ミニ	4661.50	+11.50

(出所: SBILM)

21:30

◀ 経済指標の結果 ▶

5月カナダ卸売売上高(前月比) -1.0%(予想 0.0%・前回 1.7%)

前回発表の 1.9%から 1.7%に修正



(出所: ブルームバーグ)

21:40

◀ 要人発言 ▶

ブラッド・セントルイス連銀総裁

- ・「9月利上げの可能性は50%上回る」
- ・「金利をゼロから引き上げ、会合ごとに検討するのが賢明」

- ・「ギリシャや中国株の動向は米国に打撃を与えない」
- ・「資産価格はバブルの領域にはないがリスクだ」

《ポイント》

20 日のアジア時間の取引で金現物が 4%急落、2010 年 3 月以来の安値をつけた。米利上げ観測を背景とするドルの先高観が背景。プラチナも 5%急落で 2009 年 2 月以来の安値、パラジウムも 3.4%下落で 2012 年 10 月以来の安値を付ける動きとなった。

22 : 33

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	18106.39	+19.94
ナスダック	5222.43	+12.28

(出所: SBILM)

《海外の話題》

米国とキューバは、54 年ぶりに正式に国交を回復し、双方の首都に互いの大使館を再開させた。米ワシントンにあるキューバの利益代表部は大使館に格上げされる。20 日午前 10 時 30 分（日本時間午後 11 時 30 分）頃にキューバ国旗の掲揚が行われ、キューバのロドリゲス外相が出席する。外相はその後、ケリー米国務長官と会談する。キューバの首都ハバナでも米大使館が再開。ただ、米国の国旗は、来月に予定されているケリー長官のキューバ訪問時に掲げられる。両国は 1961 年に国交を断絶した。国交正常化は昨年 12 月、オバマ米大統領とキューバのラウル・カストロ国家評議会議長が発表した。

23 : 25

IMF～ギリシャは延滞していた債務の返済を完済した

23 : 30

《 NY 株式市場 序盤》

序盤の株式市場は、新規の取引材料に乏しい中、米企業業績の先行きを期待した買いが入る一方、高値警戒感から売りも出て、序盤から売り買い交錯する展開が続いている。

《ポイント》

調査会社によると、米 S&P 総合 500 種指数採用企業の 2015 年第 2・四半期決算は、前年同期比で 1.7%の減益となる見通し。これまでに 500 社中 60 社が第 2・四半期決算を発表。利益がアナリスト予想を上回った企業の割合は 72%。長期平均の 63%、過去 4 四半期の平均 69%をともに上回った。売上高がアナリスト予想を上回った企業の比率は 50%。これは長期平均の 60%、過去 4 四半期の平均 56%をともに下回っている。

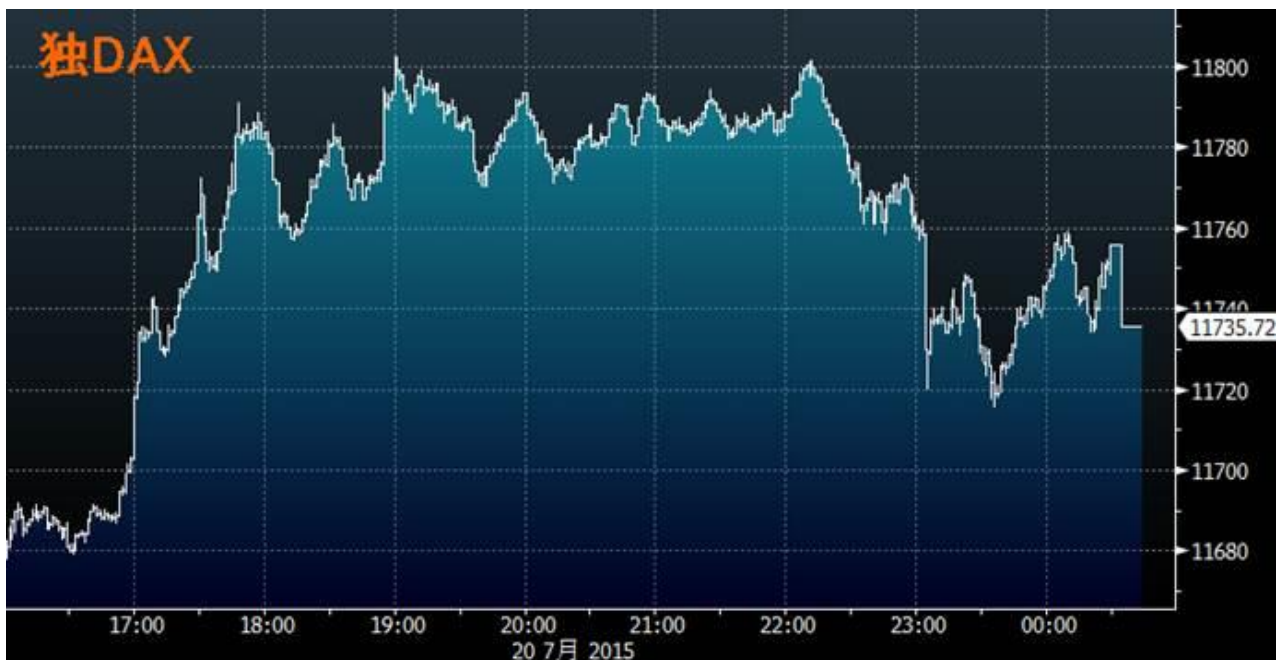
2015 年第 2・四半期の 1 株利益について、悪化もしくは市場見通しを下回ると予測している企業は 98 社、改善もしくは市場見通しを上回ると予測した企業は 25 社。悪化を改善で割ったネガティブ／ポジティブレシオ（98/25 社）は 3.9。500 社の今後 4 四半期（15 年第 3・四半期-16 年第 2・四半期）の予想株価収益率（PER）は 17.0 倍。7 月 20 日から始まる週は、126 社が 15 年第 2・四半期の決算発表を予定している。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6788.69	+13.61
仏 CAC40	5142.49	+18.10
独 DAX	11735.72	+62.30
ストック欧州 600 指数	406.80	+1.12
ユーロファースト 300 指数	1613.95	+5.36
スペイン IBEX35 指数	11556.10	+75.40
イタリア FTSE MIB 指数	24031.19	+265.78
南ア アフリカ全株指数	52988.32	+264.60

(出所: SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、ギリシャが ECB に国債償還に伴う支払い手続きを行い、IMF への債務も返済したことで、ギリシャのユーロ離脱懸念が後退し、主要株価は堅調な動きとなった。



(出所: ブルームバーク)

1 : 00

米主要株価・中盤

ダウ 18112.67 (+26.22) 、S&P500 2128.81 (+2.17) ナスダック 5220.82 (+10.67)

《欧州のポイント》

①イタリアのレンツィ首相は、批判が集まっていた不動産税を来年廃止する方針を発表し、今後も追加的な減税を実施する姿勢を示した。税收減による財政への悪影響は限られる見込みだという。レンツィ首相はミラノ郊外で開催された党の集会で、居住物件についての課税を来年から廃止すると言明。財政への影響規模は明らかにしなかったが、過去の試算によれば年間 40 億ユーロ (43 億 3000 万ドル) 程度の税収があったという。首相は、2017 年から法人税、18 年から所得税や年金への課税を軽減する方針も打ち出した。

②7月17日時点の公的部門購入プログラムは2276億ユーロ（7月10日2164億ユーロ）、資産担保証券（ABS）購入プログラムは94億ユーロ（9.3億ユーロ）、カバード債購入プログラム第3弾1002億ユーロ（983億ユーロ）

《 NY 債券市場 ・ 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、ブラード・セントルイス連銀総裁が9月のFOMCでの利上げ開始確率は50%超との見解を示したことが材料視され、売りが先行した。また、ギリシャがIMFに対して債務を返済し、国内銀行の営業も再開したことから、ギリシャの財政危機への懸念を背景とした逃避買いも後退した。

午前の利回りは、30年債が3.09%（前週末3.08%）、10年債が2.37%（2.35%）、7年債が2.10%（2.08%）、5年債が1.70%（1.67%）、3年債が1.08%（1.05%）、2年債が0.70%（0.67%）。

3:40

NY金は、中心限月が前日比25.10ドル安の1オンス=1106.80ドルで取引を終了した。

4:15

NY原油は、中心限月が前日比0.74ドル安の1バレル=50.15ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1106.80	-25.10
NY 原油	50.15	-0.74

（出所：SBILM）

《 NY 金市場 》

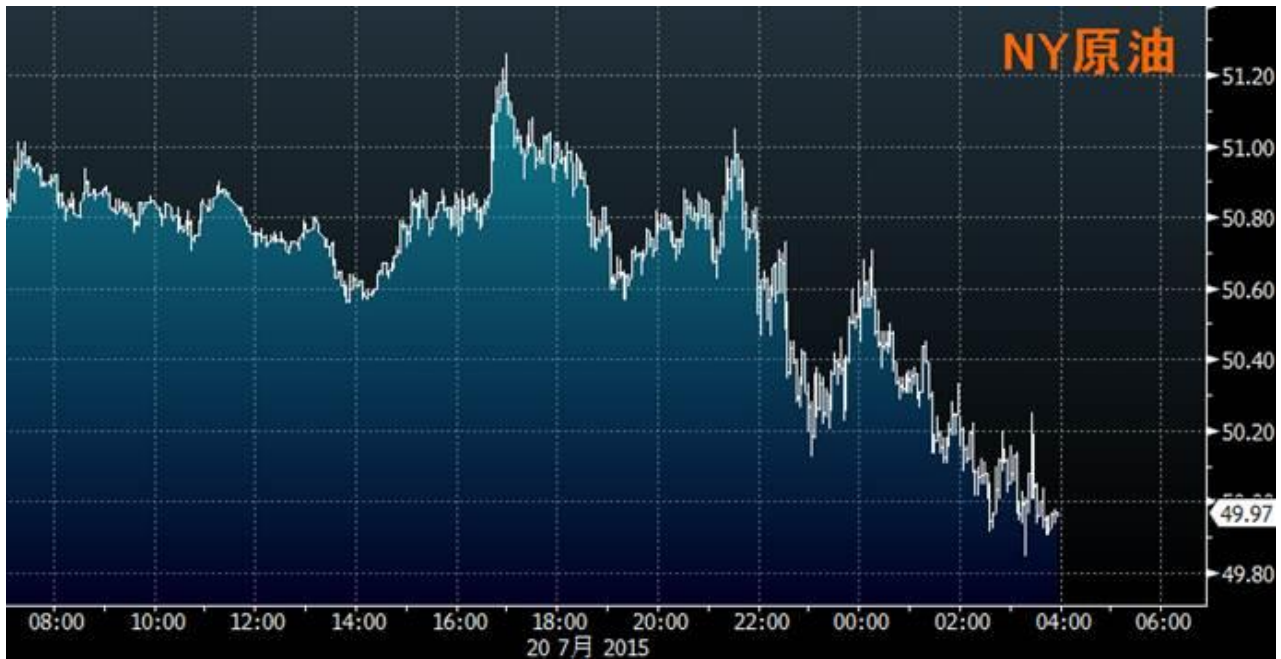
NY金は、年内の米利上げ観測を背景に金を売る動きが続いた上、中国の中央銀行の金保有高が市場の予想を下回ったとの報道を受けて、売りが優勢となった。終値ベースでは、2010年3月以来、約5年4ヵ月ぶりの安値水準となった。



（出所：ブルームバーグ）

<< NY 原油市場 >>

NY原油は、新規の手掛かり材料に乏しい中、世界的な供給過剰への懸念から売りが先行した。また、ドルが主要通貨に対して上昇傾向にあり、ドル建ての原油の割高感も相場を圧迫した。一時1バレル=49ドル台まで下落となり、4月上旬以来、約3ヵ月半ぶりに50ドルの大口を割り込んだ。また、終値ベースでも4月上旬以来の安値となった。



(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	18100.41	+13.96	18137.12	18064.50
S&P500 種	2128.28	+1.64	2132.82	2123.65
ナスダック	5218.86	+8.72	5231.94	5201.49

(出所：SBILM)

<< 米株式市場 >>

米株式市場は、米国の経済指標の発表がなく、新規の取引材料に乏しい中、米企業業績の先行きを期待した買いが入る一方、高値警戒感から売りも出て、序盤から売り買い交錯する展開が続いた。ただ、その後は終盤まで小動きながら堅調な動きが続いた。



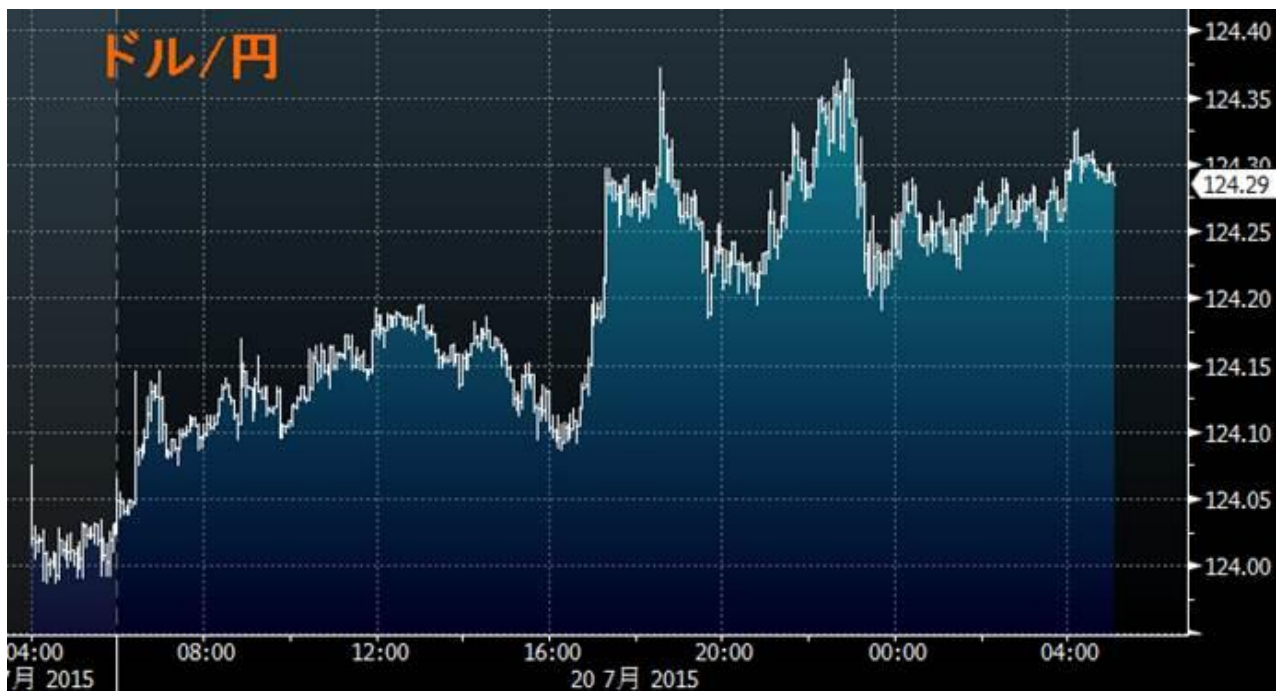
(出所：ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	124.30	124.38	124.20
EUR/JPY	134.56	135.05	134.56
GBP/JPY	193.49	193.91	193.19
AUD/JPY	91.63	91.81	91.35
NZD/JPY	81.66	81.88	81.39
EUR/USD	1.0827	1.0871	1.0825
AUD/USD	0.7372	0.7391	0.7347

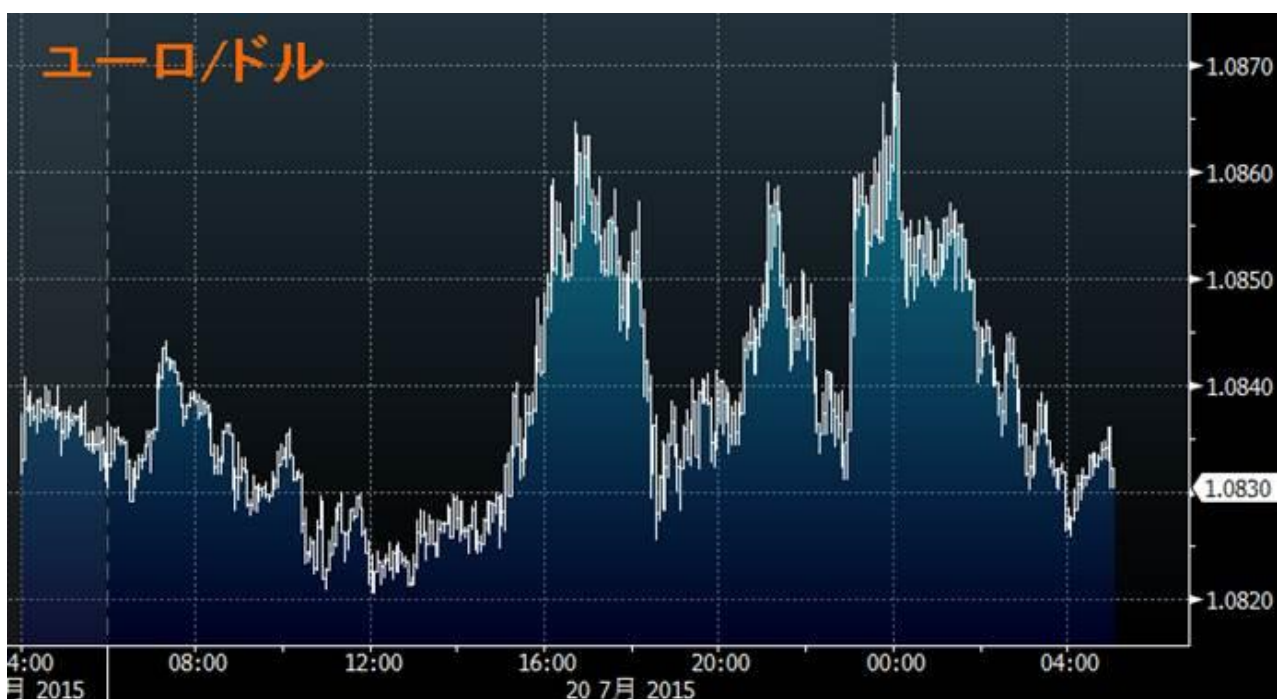
(出所：SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、米国の主要な経済指標の発表がなく、材料に乏しい中、全般的にやや限定的な動きが続いた。ドルは、当局者の利上げ時期に関する発言を受けて上昇する場面もあったが、長期債利回りの低下を受けて反落する動きとなった。一方、ユーロはギリシャが債務返済を実施したとの報道を受けて上昇したものの、その後は終盤まで上値の重い動きが続いた。



(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。