

NY マーケットレポート (2015 年 7 月 27 日)

アジアや欧州の主要株価が全面安の展開となり、世界経済への先行き懸念が広がったことを受けて、欧州タイムから投資家のリスク回避の動きが続いており、NY 市場でもこの流れを受けて序盤からドル円・クロス円は軟調な動きとなった。また、序盤に発表された米耐久財受注が市場予想を上回る結果となったものの、前回結果が下方修正され、コア指数がマイナスとなったことや、米長期債利回りの低下を受けて、ドルは主要通貨に対して軟調な動きとなった。一方、ユーロは、ドイツの経済指標が市場予想に反して改善したことが材料視され、主要通貨に対して堅調な動きとなった。また、その他のクロス円も堅調な動きとなった。ただ、米 FOMC を控えて様子見ムードもあり、午後には全般的に上値の重い動きが続いた。

2015/7/27 (月)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	123.39	123.84	123.36
EUR/JPY	136.06	135.99	135.75
GBP/JPY	191.22	192.22	191.11
AUD/JPY	89.80	90.22	89.65
EUR/USD	1.1029	1.1041	1.0969

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	123.57	123.19
EUR/JPY	136.99	136.31
GBP/JPY	191.78	191.02
AUD/JPY	90.07	89.70
EUR/USD	1.1114	1.1058

*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	20350.10	-194.43
ハンセン指数	24351.96	-776.55
上海総合	3725.56	-345.35
韓国総合指数	2038.81	-7.15
豪ASX200	5589.89	+23.78
インドSENSEX指数	27561.38	-550.93
シンガポールST指数	3313.42	-39.23

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6505.13	-74.68
仏CAC40	4927.60	-129.76
独DAX	11056.40	-291.05
ST欧州600	385.91	-8.73
西IBX35指数	11145.40	-163.90
伊FTSE MIB指数	22809.30	-698.40
南ア 全株指数	51301.55	-54.53

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	123.29	123.31	123.02
EUR/JPY	136.74	137.10	136.18
GBP/JPY	191.82	192.20	191.07
AUD/JPY	89.68	90.12	89.58
NZD/JPY	81.46	81.78	81.35
EUR/USD	1.1093	1.1129	1.1051
AUD/USD	0.7274	0.7325	0.7271

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17440.59	-127.94
S&P500	2067.64	-12.01
NASDAQ	5039.78	-48.85
その他主要株	終値	前日比
カナダトロント総合	14001.37	-184.87
ブラジルボルサ指数	43713.72	-535.77
ボネバ指数	48735.54	-510.30

7/28 経済指標スケジュール

16:30 【スウェーデン】6月小売売上高
 17:30 【英】2Q GDP
 17:30 【英】5月サービス業指数
 18:30 【南ア】2Q失業率
 21:30 【カナダ】6月原料価格指数
 21:30 【カナダ】6月鉱工業製品価格
 22:00 【米】5月S&P/ケース・シラー[総合20]
 23:00 【米】7月消費者信頼感指数
 23:00 【米】7月リッチモンド連銀製造業指数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1069.40	+10.90
NY 原油	47.39	-0.75
CMEコーン	383.50	-19.25
CBOT 大豆	933.25	-31.75

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.65%	0.68%
3年債	0.99%	1.04%
5年債	1.56%	1.62%
7年債	1.95%	2.00%
10年債	2.22%	2.26%
30年債	2.93%	2.96%

7/28 主要会議・講演・その他予定

- ・米2年債入札
- ・FOMC (～29日)

(出所:SBILM)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 123.20 ユーロ/円 136.33 ユーロ/ドル 1.1067

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	6545.11	-34.70	ダウ 先物ミニ	17417	-106
仏 CAC40	4967.17	-90.19	S&P 500 ミニ	2067.00	-10.50
独 DAX	11154.73	-192.72	NASDAQ 100 ミニ	4530.50	-31.25

(出所: SBILM)

21:30

◀ 経済指標の結果 ▶

6月米耐久財受注(前月比) 3.4%(予想 3.2%・前回 -2.1%)

前回発表の-1.8%から-2.1%に修正

6月米耐久財受注[除輸送用機器](前月比) 0.8%(予想 0.5%・前回 -0.1%)

前回発表の0.5%から-0.1%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

《米耐久財受注》

	6月	5月	4月	3月	2月	1月
耐久財新規受注	3.4	-2.1	-1.7	5.1	-3.5	2.9
輸送機器除く	0.8	-0.1	-0.6	0.6	-1.7	-0.3
国防関連除く	3.8	-2.4	-1.0	3.4	-3.0	3.2
資本財	8.1	-5.2	-3.4	8.4	-4.3	7.5
輸送機器	8.9	-6.1	-4.0	15.2	-7.3	10.6
総受注残	0.1	-0.5	-0.2	0.1	-0.6	-0.1
総在庫	0.4	-0.2	0.2	0.0	0.3	0.3
総出荷	0.1	-0.3	-0.3	1.5	-1.1	-0.9

22 : 00

《 経済指標の結果 》

6月メキシコ貿易収支 -7億4900万 MXN (予想 -5億0140万 MXN・前回 -10億1740万 MXN)



(出所：ブルームバーグ)

22 : 36

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17426.56	-141.97
ナスダック	5040.22	+48.41

(出所: SBILM)

23 : 30

◀ 経済指標の結果 ▶

7月ダラス連銀製造業活動指数 -4.6 (予想 -3.0・前回 -7.0)



(出所: ブルームバーグ)

23 : 35

◀ NY 株式市場 序盤 ▶

序盤の株式市場は、上海株式市場が急落したのを受けて、中国景気の減速による世界経済への悪影響を警戒した売りが世界的に広がっており、米主要株価も軟調な動きとなっている。

◀ 経済指標のポイント ▶

6月の米耐久財受注は、市場予想の3.0%を上回る前月比3.4%の2353億3700万ドルとなり、3ヵ月ぶりに増加した。輸送機器で自動車や航空機がプラスとなったほか、電機・家電なども増加したことが全体を押し上げた。

①輸送機器が+8.9%となり、変動の激しい民間航空機が%、国防関連の航空機が+16.9%、自動車・同部品が+0.2%。輸送機器を除いた受注は+0.8%と3ヵ月ぶりのプラスとなり、昨年8月以来の大きな伸び率となった。

②輸送機器以外では、一般機械が+1.4%、電算機は+9.1%、電機・家電は+2.8%と昨年12月以来の高い伸び、一方、一次金属は-1.4%、通信機器は-0.8%だった。

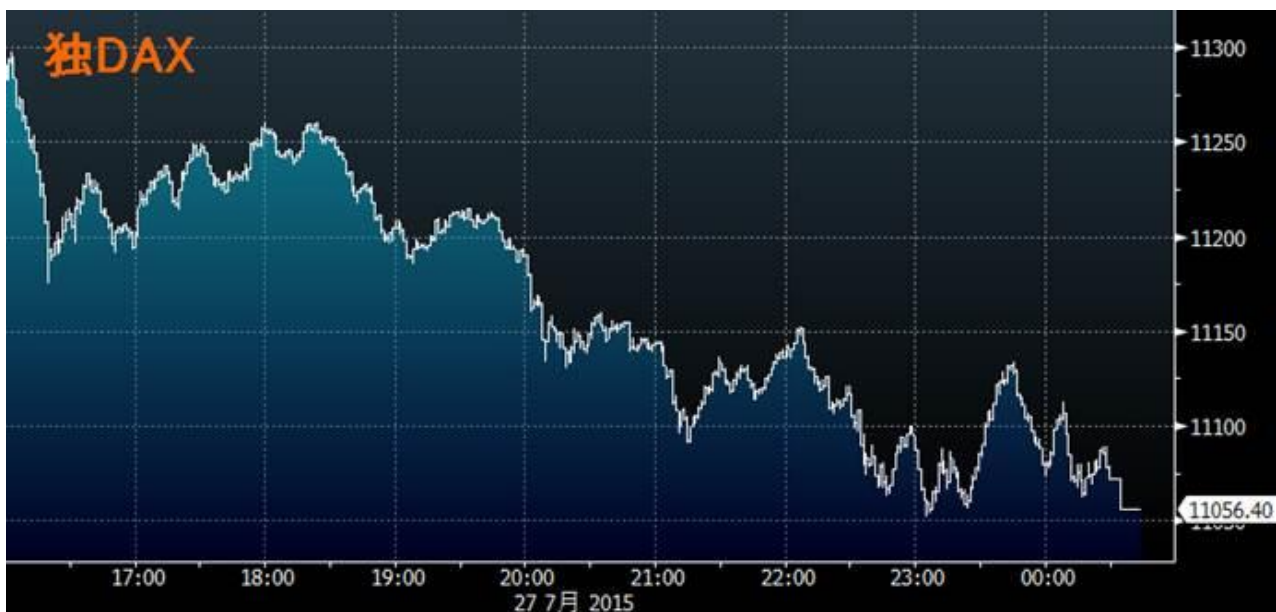
③資本財は+8.1%、資本財から国防関連を除いた受注は+9.4%。民間設備投資の先行指標となる非国防資本財から航空機を除いたコア受注は+0.9%、国防関連は-2.5%。耐久財全体の出荷高と受注残高はそれぞれ+0.1%、在庫高は+0.4%となった。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6505.13	-74.68
仏 CAC40	4927.60	-129.76
独 DAX	11056.40	-291.05
ストック欧州 600 指数	385.91	-8.73
ユーロファースト 300 指数	1529.77	-34.26
スペイン IBEX35 指数	11145.40	-163.90
イタリア FTSE MIB 指数	22809.30	-698.40
南ア アフリカ全株指数	51301.55	-54.53

(出所: SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、上海株式市場の急落で中国景気の減速懸念が広がり、投資家がリスク回避姿勢を強めたことを受けて、主要株価は軟調な動きとなった。



(出所: ブルームバーグ)

1:00

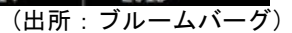
米主要株価・中盤

ダウ 17459.16 (-109.37)、S&P500 2069.91 (-9.74) ナスダック 5050.57 (-38.06)

1:00

《経済指標の結果》

6月フランス求職者数合計 355.4万人(予想 356.0万人・前回 355.2万人)



《欧州のポイント》

①欧州委員会は、ギリシャ向け第3次金融支援をめぐる協議が始まったと明らかにした。協議は先週始まる予定だったが、技術的な問題で開始が遅れていた。欧州委の報道官は「債権団の派遣チームはすでにアテネ入りしており、直ちに作業を開始する。債権団とギリシャ側の協議が始まった」と述べた。

②ECBが発表したデータによると、6月のギリシャの銀行預金残高は1275億ユーロ（1410億ドル）となり、約6%減少した。ギリシャがユーロ圏から離脱するのではないかと懸念から預金が引き出された。預金残高は2003年末頃以来の低水準。ギリシャ政府は6月28日に銀行の一時閉鎖と資本規制の導入を決定したが、それよりも前に預金大幅に流出していたことが示された。銀行は、現在は再開しているが、引き出し制限が設けられている。

《ポイント》

ECB	7月24日	7月17日	7月10日
公的部門 購入プログラム	237,880	227,617	216,346
資産担保証券 (ABS) 購入プログラム	9,454	9,377	9,313
カバード債 購入プログラム第3弾	101,686	100,175	98,246

《 NY 債券市場 · 午前 》

序盤のニューヨーク債券市場は、中国・上海市場の株価が急落し、欧米株にも売りが波及したことから投資家がリスク回避の姿勢を強め、安全資産とされる米国債の逃避買いが先行した。ただ、28-29日の米FOMCを控えて様子見ムードも強く、やや限定的な動きとなった。

午前の利回りは、30年債が[※]2.94%（前週末2.96%）、10年債が[※]2.23%（2.26%）、7年債が[※]1.96%（2.00）、5年債が[※]1.57%（1.62%）、3年債が[※]1.00%（1.04%）、2年債が[※]0.66%（0.68%）。

3 : 50

NY 金は、中心限月が前週末比 10.90 ドル高の 1 オンス=1096.40 ドルで取引を終了した。

4 : 20

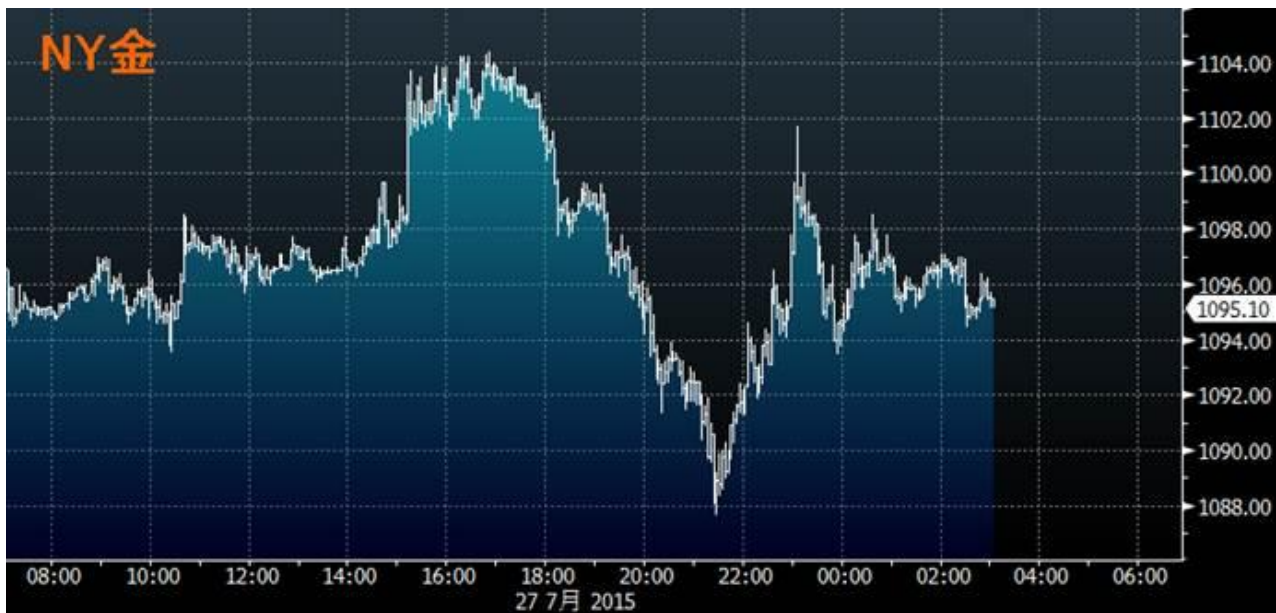
NY 原油は、中心限月が前週末比 0.75 ドル安の 1 バレル＝47.39 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1069.40	+10.90
NY 原油	47.39	-0.75

(出所: SBILM)

《 NY 金市場 》

NY 金は、中国株の急落で投資家のリスク回避志向が広がり、比較的安全な資産とされる金を買う動きが優勢となった。また、ドルが主要通貨に対して下落したため、ドルの代替資産としての需要も高まった。



(出所: ブルームバーク)

《 NY 原油市場 》

NY 原油は、世界的な供給過剰への懸念に加え、中国株の急落で景気の減速に伴うエネルギー需要の低迷観測も広がり、4 営業日続落となった。終値ベースでは、3 月 20 日以来、約 4 ヶ月ぶりの安値水準となった。



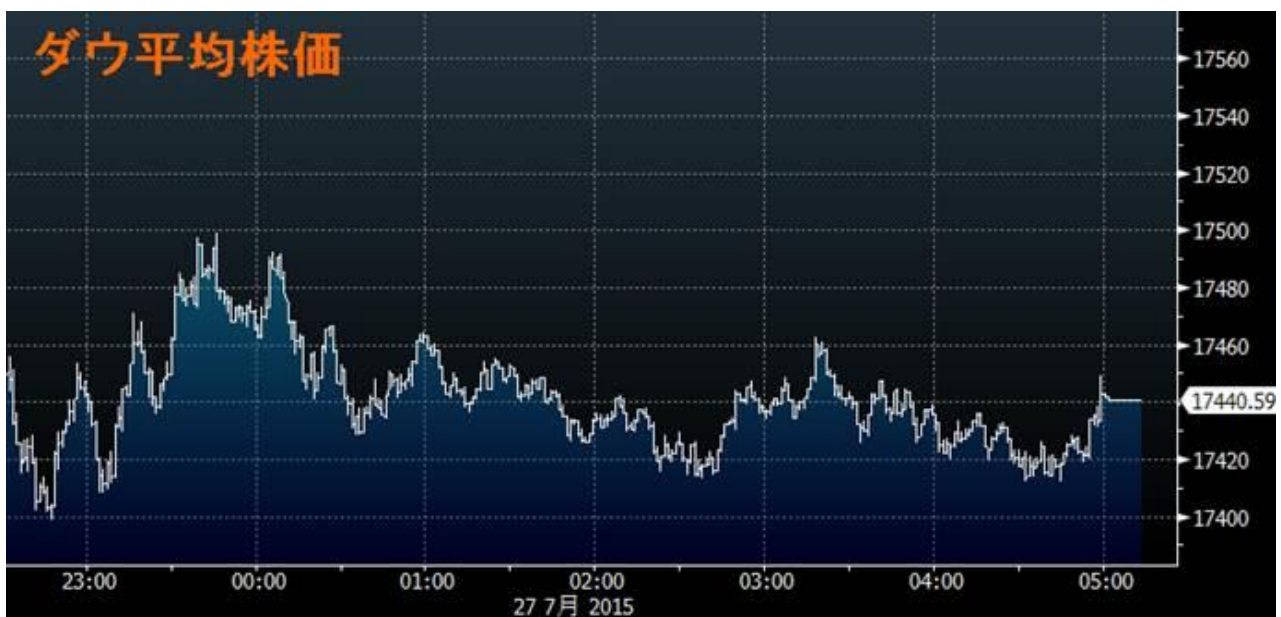
(出所：ブルームバーグ)

主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	17440.59	-127.94	17561.78	17399.17
S&P500 種	2067.64	-12.01	2078.19	2063.52
ナスダック	5039.78	-48.85	5072.88	5032.70

(出所：SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、上海株式市場が急落したのを受けて、中国景気の減速による世界経済への悪影響を警戒した売りが世界的に広がっており、米主要株価も序盤から軟調な動きが続いた。ダウ平均株価は、序盤から軟調な動きが続き、一時前週末比で 169 ドル安まで下げる動きとなった。



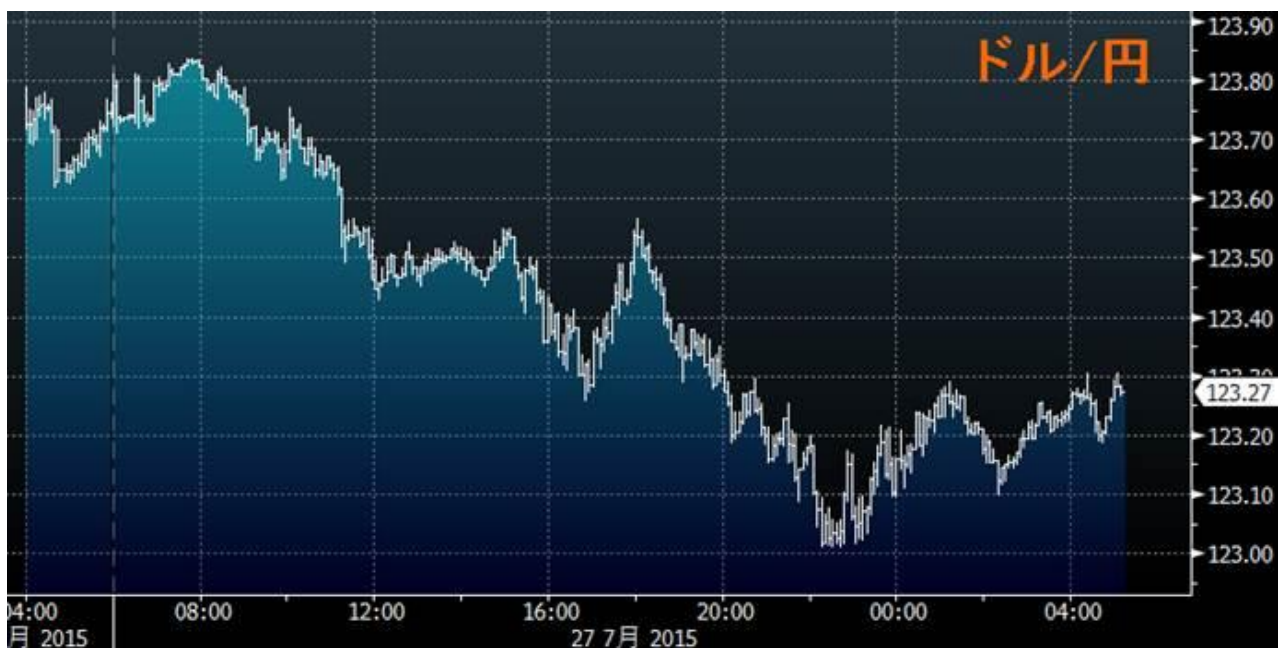
(出所：ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	123.29	123.31	123.02
EUR/JPY	136.74	137.10	136.18
GBP/JPY	191.82	192.20	191.07
AUD/JPY	89.68	90.12	89.58
NZD/JPY	81.46	81.78	81.35
EUR/USD	1.1093	1.1129	1.1051
AUD/USD	0.7274	0.7325	0.7271

(出所: SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、アジアや欧州の主要株価下落を背景に、投資家のリスク回避の動きが続いており、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、ドルは米経済指標が懸念の残る内容となったことから、主要通貨に対して軟調な動きとなった。その他のクロス円は、値を戻す動きとなったものの、上値は限定的となった。



(出所: ブルームバーグ)



(出所: ブルームバーク)

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自身でお願いします。