

NY マーケットレポート (2015年7月28日)

NY 市場では、序盤に発表された米住宅関連の経済指標が予想を下回る結果となったことや、米消費者信頼感指数が昨年 9 月以来の低水準となり、2011 年 8 月以来の大幅な低下となったことを受けて、ドルが主要通貨に対して軟調な動きとなった。また、欧米の堅調な株価動向を背景に円が売られ、クロス円は堅調な動きとなった。ただ、米 FOMC の声明を控えて様子見ムードも高まりつつあり、全般的にやや値動きは限定的となった。

2015/7/28 (火)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	123.65	123.71	123.08
EUR/JPY	136.77	136.96	136.48
GBP/JPY	192.18	192.54	191.47
AUD/JPY	90.26	90.53	89.34
EUR/USD	1.1061	1.1100	1.1052

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	123.80	123.55
EUR/JPY	136.96	136.37
GBP/JPY	193.24	191.99
AUD/JPY	90.59	90.20
EUR/USD	1.1074	1.1022

*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	20328.89	-21.21
ハンセン指数	24503.94	+151.98
上海総合	3663.00	-62.56
韓国総合指数	2039.10	+0.29
豪ASX200	5584.69	-5.20
インドSENSEX指数	27459.23	-102.15
シンガポールST指数	3281.09	-32.33

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6555.28	+50.15
仏CAC40	4977.32	+49.72
独DAX	11173.91	+117.51
ST欧州600	390.02	+4.11
西IBX35指数	11252.40	+107.00
伊FTSE MIB指数	23328.02	+518.72
南ア 全株指数	50758.42	-543.13

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	123.55	123.80	123.51
EUR/JPY	136.61	136.68	136.37
GBP/JPY	192.89	193.04	192.50
AUD/JPY	90.49	90.72	90.18
NZD/JPY	82.47	82.87	82.39
EUR/USD	1.1058	1.1065	1.1024
AUD/USD	0.7324	0.7345	0.7297

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17630.27	+189.68
S&P500	2093.25	+25.61
NASDAQ	5089.21	+49.43
その他主要株	終値	前日比
🇨🇦 トロント総合	14077.36	+75.99
🇧🇷 ボルサ指数	44222.97	+509.25
🇲🇽 ボベスパ指数	49601.60	+866.05

7/29 経済指標スケジュール

08:50	【日】6月大型小売店販売額
08:50	【日】6月小売業販売額
15:00	【スイス】6月UBS消費指数
15:00	【ドイツ】8月GfK消費者信頼感調査
15:00	【南ア】6月マネーサプライM3
15:00	【南ア】6月民間部門信用
15:45	【仏】7月消費者信頼感指数
17:30	【英】6月マネーサプライM4
17:30	【英】6月住宅証券融資高
17:30	【英】6月消費者信用残高
17:30	【英】6月住宅ローン承認件数
17:30	【英】7月CBI流通取引調査
20:00	【米】MBA住宅ローン申請指数
23:00	【米】6月中古住宅販売成約
03:00	【米】FOMC 政策金利発表

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1096.20	-0.20
NY 原油	47.98	+0.59
CMEコーン	385.50	+2.00
CBOT 大豆	944.75	+11.50

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.67%	0.65%
3年債	1.02%	0.99%
5年債	1.59%	1.56%
7年債	1.98%	1.95%
10年債	2.25%	2.22%
30年債	2.97%	2.93%

7/29 主要会議・講演・その他予定

- ・米5年債入札
- ・FOMC

(出所:SBILM)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 123.77 ユーロ/円 136.50 ユーロ/ドル 1.1030

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	6556.17	+51.04	ダウ 先物ミニ	17469	+73
仏 CAC40	4985.56	+57.96	S&P 500 ミニ	2074.25	+9.75
独 DAX	11211.38	+154.98	NASDAQ 100 ミニ	4538.75	+16.25

(出所: SBILM)

21:00

《企業決算》

米フォード

第2四半期の1株利益は0.47ドル、(予想0.37ドル)

米UPS

第2四半期の調整後1株利益は1.35ドル(予想1.26ドル)

米デュポン

第2四半期の1株利益1.18ドル(予想1.21ドル)

21:30

《経済指標の結果》

6月カナダ原料価格指数(前月比) 0.0%(予想 1.0%・前回 4.4%)

6月カナダ鉱工業製品価格(前月比) 0.5%(予想 0.4%・前回 0.5%)



(出所：ブルームバーグ)



(出所：ブルームバーグ)

22:00

≪ 経済指標の結果 ≫

5月米 S&P/ケース・シラー[総合 20] 179.03 (予想 180.34・前回 177.08)
 前回発表の 177.01 から 177.08 に修正

5月米 S&P/ケース・シラー[総合 20] (前月比) -0.18% (予想 0.30%・前回 -0.03%)
 前回発表の 0.30%から-0.03%に修正

5月米 S&P/ケース・シラー[総合 20] (前年比) 4.94% (予想 5.60%・前回 4.95%)
 前回発表の 4.91%から 4.95%に修正



(出所：ブルームバーグ)

経済指標データ

《S&P/ケース・シラー住宅価格指数》

(米主要 20 都市) 季調前	5 月	4 月	3 月	2 月	1 月	12 月
指数	179.03	177.08	175.07	173.55	172.75	172.93
前月比	1.10	1.15	0.88	0.46	-0.11	0.04
前年比	4.94	4.95	4.96	4.96	4.44	4.41
(米主要 10 都市) 季調前	5 月	4 月	3 月	2 月	1 月	12 月
指数	194.00	191.90	189.85	188.47	187.54	187.74
前月比	1.09	1.08	0.73	0.50	-0.11	0.07
前年比	4.68	4.67	4.64	4.73	4.22	4.26

22 : 33

米主要株価

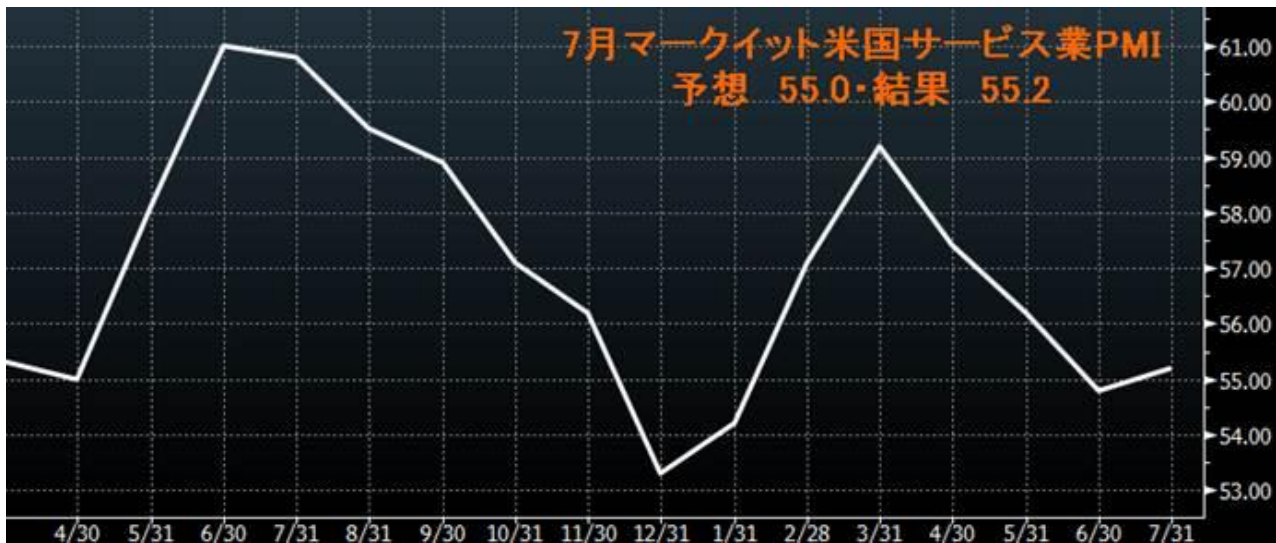
米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17483.32	+42.73
ナスダック	5058.91	+19.13

(出所：SBILM)

22 : 45

《 経済指標の結果 》

7 月マークイット米国サービス業 PMI 55.2 (予想 55.0・前回 54.8)

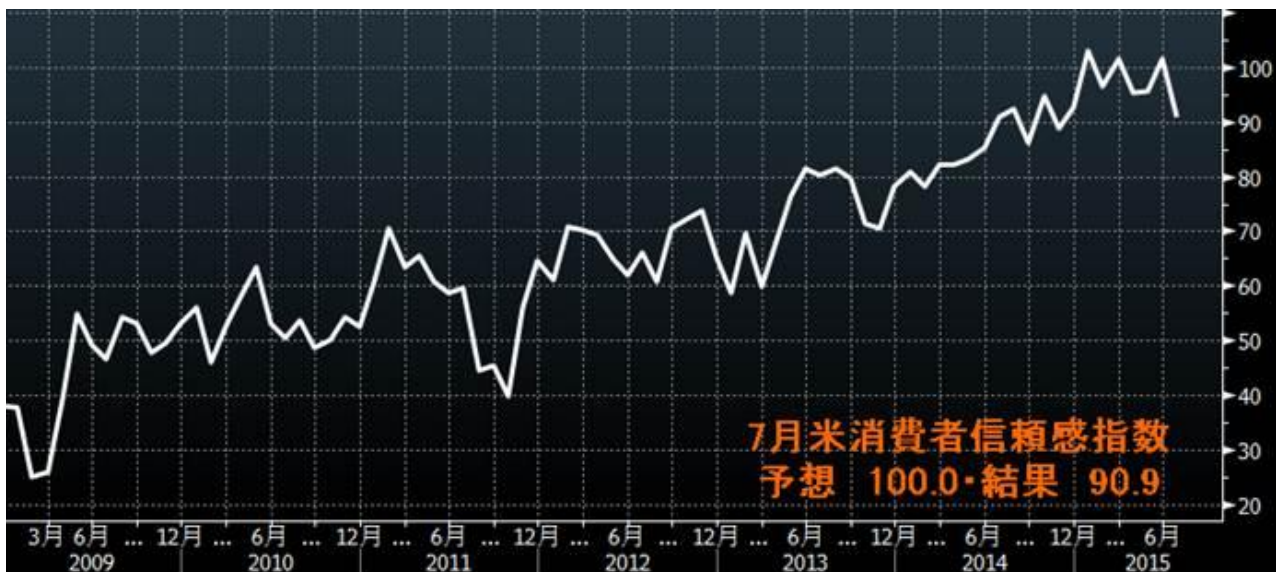


(出所：ブルームバーグ)

23:00

◀ 経済指標の結果 ▶

7月米消費者信頼感指数 90.9 (予想 100.0・前回 99.8)
前回発表の 101.4 から 99.8 に修正



(出所：ブルームバーグ)

経済指標データ

◀ 消費者信頼感指数 ▶ 7月・・・6月・・・5月・・・4月・・・3月・・・2月
 信頼感指数・・・90.9・・・99.8・・・94.6・・・94.3・・・101.4・・・98.8
 現況指数・・・107.4・・・110.3・・・107.1・・・105.1・・・109.5・・・112.1
 期待指数・・・79.9・・・92.8・・・86.2・・・87.1・・・96.0・・・90.0

【現況指数】

業況

良好・・・24.2・・・26.1・・・24.7・・・25.5・・・26.7・・・26.7
 悪化・・・17.9・・・18.0・・・17.9・・・19.2・・・19.4・・・16.7

普通・・・57.9・・・55.9・・・57.4・・・55.3・・・53.9・・・56.6

【雇用】

十分・・・20.7・・・21.3・・・20.6・・・19.0・・・21.0・・・20.3

不十分・・・52.6・・・52.6・・・52.2・・・55.1・・・53.5・・・54.6

困難・・・26.7・・・26.1・・・27.2・・・25.9・・・25.5・・・25.1

【半年先】

業況

改善・・・14.7・・・17.9・・・16.0・・・15.4・・・16.8・・・17.6

悪化・・・10.7・・・10.2・・・11.3・・・9.1・・・8.1・・・8.9

横ばい・・・74.6・・・71.9・・・72.7・・・75.5・・・75.1・・・73.5

雇用

改善・・・13.1・・・17.1・・・14.7・・・13.8・・・15.3・・・13.8

悪化・・・20.0・・・15.2・・・16.6・・・16.4・・・13.6・・・14.8

横ばい・・・66.9・・・67.7・・・68.7・・・69.8・・・71.1・・・71.4

23:05

◀ 経済指標の結果 ▶

7月リッチモンド連銀製造業指数 13 (予想 7・前回 7)

前回発表の6から7に修正



(出所：ブルームバーグ)

経済指標データ

◀ リッチモンド連銀製造業指数 ▶

7月・6月・5月・4月・3月・2月

景況指数・・・13・・・7・・・1・・・-3・・・-8・・・0

出荷・・・16・・・5・・・0・・・-6・・・-13・・・-1

新規受注・・・17・・・10・・・4・・・-6・・・-13・・・-2

受注残・・・10・・・3・・・-7・・・-8・・・-12・・・-10

雇用者数・・・1・・・6・・・5・・・7・・・6・・・4

価格動向 7月・6月・5月・4月・3月・2月

仕入価格・・・1.45・0.97・0.82・0.69・0.62・0.32

販売価格・・・0.58・0.59・0.47・0.51・0.10・0.09

23 : 10

IMF 対外セクター年次報告

- ・「日本は成長と価格押し上げへ強力な改革が必要」
- ・「豪ドルは、ファンダメンタルズより最大 15%強い可能性」
- ・「米ドルは、ファンダメンタルズが示唆する水準を小幅上回る」

23 : 30

◀ NY 株式市場 序盤 ▶

序盤の株式市場は、ダウは前日まで 5 営業日連続で値下がりしたため、割安感の出た銘柄に買いが先行した。また、欧州の株高も買い投資家心理を和らげた。

◀ 経済指標のポイント ▶

(1) 5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数の主要 20 都市圏の住宅価格動向を示す指数は前年同月比+4.9%となり、市場予想の+5.6%を下回った。住宅建設が停滞したことで、新築の販売は中古と比べると遅れた。都市別では、デンバーが+10.0%、サンフランシスコが+9.7%、ダラスが+8.4%。住宅価格は上昇を続けており、ほかの住宅関連統計よりも前向きな内容としながらも、価格の上昇率は 4-5%台に落ち着き、2 桁のペースで伸びていた 2013 年と比べると勢いがなくなってきたと S&P 担当者が指摘。新規購入者の少なさが価格の伸び悩みの原因だとした。

(2) 第 2・四半期の米住宅所有率は 63.5%と、統計開始以来の最低の水準に達した。賃貸を 선호する米国人が増加していることが浮き彫りとなった。前四半期は 63.8%。ピークは 2004 年の 69.4%。同時に、賃貸住宅の空家率は 6.8%と、前四半期の 7.1%から低下し、1985 年以來の低水準となった。

(3) 7月のマークイット米サービス PMI 速報値は 55.2 で、市場予想の 55.0 を上回り、6月の改定値 54.8 から上昇した。雇用や新規事業の伸びが全体水準を押し上げた。当該指数は、50 が景気の拡大と悪化の判断基準となる。構成指数では、新規事業が 56.8 (6月 56.3) と 4月以來の高水準、雇用指数も前月から伸びた。マークイットのチーフエコノミストは「経済が持続的に拡大しており、雇用市場にも波及を続けている。雇用指数は 7月も採用状況が良かったことを示す」と述べた。製造業とサービス業の指数を加重平均した 7月の総合 PMI 速報値は 55.2 と、6月から上昇した。

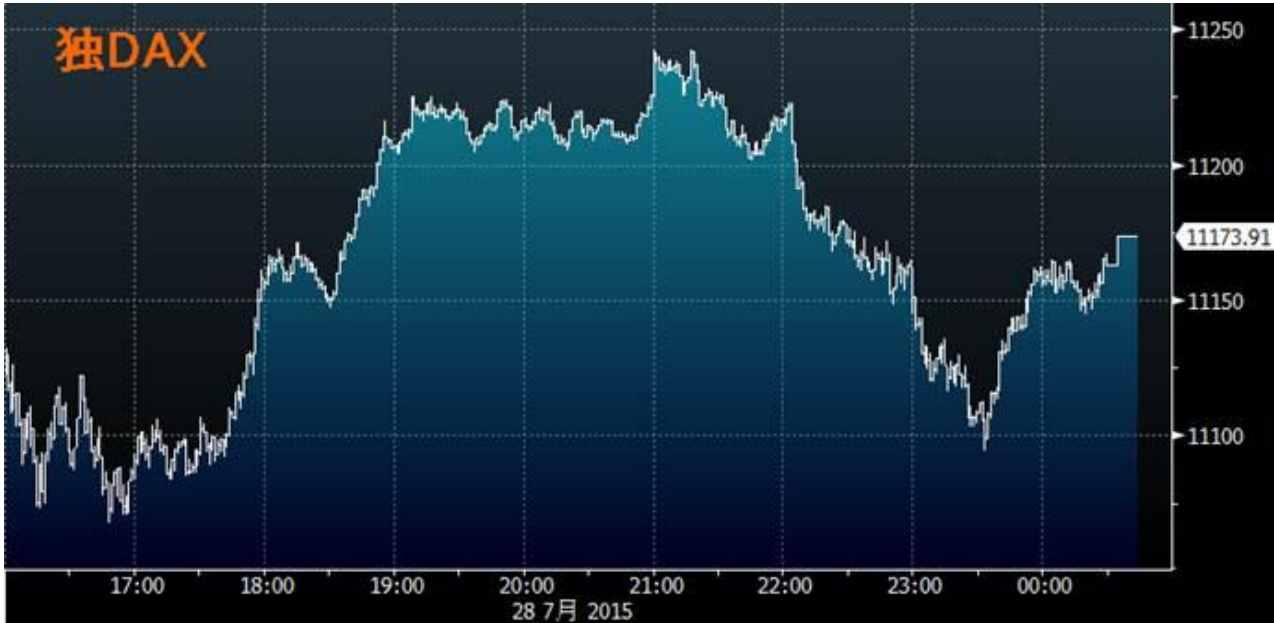
(4) 7月の米消費者信頼感指数は、90.9 と前月の 99.8 (速報値 101.4) から低下し、昨年 9月以來の低水準となり、2011 年 8月以來の大幅な低下となった。今後 6カ月の期待指数は 79.9 (前月 92.8) となり、昨年 2月以來の低水準となった。現況指数は 107.4 (前月 110.3)、ビジネス環境が良好と回答した割合は 24.2% (26.1%) と、昨年 9月以來の低い水準だった。現在雇用が十分あるとの回答比率は 20.7% (21.3%)、向こう 6カ月に雇用が増えると答えた比率は 13.1% (17.1%) と、2013 年 11月以來の低水準となった。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6555.28	+50.15
仏 CAC40	4977.32	+49.72
独 DAX	11173.91	+117.51
ストック欧州 600 指数	390.02	+4.11
ユーロファースト 300 指数	1545.79	+16.02
スペイン IBEX35 指数	11252.40	+107.00
イタリア FTSE MIB 指数	23328.02	+518.72
南ア アフリカ全株指数	50758.42	-543.13

(出所: SBILM)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、欧州企業の業績改善期待や合併・買収の動きが活発化するとの思惑が相場を支えた。また、前日までの下落で割安感が出た銘柄を中心に買い戻しも入りやすく、主要株価は反発となった。



(出所：ブルームバーグ)

1:00

米主要株価・中盤

ダウ 17550.46 (+109.87)、S&P500 2082.59 (+14.95) ナスダック 5065.45 (+25.67)

《NY債券市場・午前》

序盤のニューヨーク債券市場は、欧州や米国で株価が上昇したことから前日のリスク回避の動きが一服し、安全資産とされる米国債の売りが先行した。米2年物国債入札を前にポジション調整の売りが出たことも圧迫要因となった。ただ、米FOMCの結果発表を控えて様子見気分も強く、売り一巡後は小幅な値動きとなった。

午前の利回りは、30年債が2.97%（前日2.93%）、10年債が2.25%（2.22%）、7年債が1.98%（1.94%）、5年債が1.59%（1.56%）、3年債が1.02%（1.00%）、5年債が0.66%（0.65%）。

《欧州のポイント》

①第2・四半期の英GDP速報値は、前期比+0.7%となり予想と一致した。サービス部門や石油・天然ガス生産の拡大に支えられ、第1・四半期の+0.4%から成長率が加速した。1人あたりGDPは2008年第1・四半期につけたピークとほぼ同水準。第2・四半期のGDPは前年同期比では+2.6%と予想と一致した。GDPに占める割合が75%強に達するサービス部門の生産が前期比+0.7%。第1・四半期の+0.4%から伸び率が拡大した。製造業の生産は-0.3%となり、四半期としては2年強ぶりのマイナスに陥った。ただ、北海における石油・ガス生産が拡大し、工業部門全体の生産は+1.0%。2010年終盤以来で最大の増加率となった。

②ドイツ政府の経済諮問委員会は、公表した報告書で、ユーロ圏は将来の危機を回避するために加盟国の財政破綻を容認し、ユーロ圏からの離脱を可能にする必要があると主張した。報告書はギリシャの債務危機について、ユーロ圏の安定のために一段の改革が直ちに必要であることを浮き彫りにしたと指摘した。銀行同盟を強化させることなどに加えて、国家の秩序だった破綻を可能にすべきと主張。これにより加盟国を救済しないというユーロ圏の方針への信頼が高まるとした。

③オズボーン英財務相は、英中銀のデビッド・マイルズ金融政策委員の後任にガーティヤン・ブリハ氏（44）を指名したと英財務省が明らかにした。ブリハ氏は大手ヘッジファンド、ブレバン・ハワード・アセット・マネジメントのエコノミスト。ドイツ銀行で欧州金利担当ストラテジストを務めたほか、イングランド銀行でキング前総裁のアドバイザーを務めた経験もある。任期は3年。9月に就任する。

④ECBとIMF、ESM（欧州安定化メカニズム）、EU欧州委員会の実務者らが、最大860億ユーロ（約11兆7500億円）規模の救済のため向こう3年間にギリシャが法制化しなければならない措置について同国政府と協議するためアテネを訪れている。ECBが保有するギリシャ債の償還期限である8月20日より前に救済プログラムが整うためには、2週間以内にいわゆる覚書に調印する必要がある。これができない場合はデフォルト回避のためにさらにつなぎ融資が必要になる。

⑤ECBは、アテネ証券取引所の取引再開を条件付きで承認したことで、ギリシャ財務省の手続きを経て、29日にも再開される可能性がある取引所関係者が明らかにした。国内投資家は売買が制限されるという。ギリシャ証券取引所は、先月26日以降市場停止となっている。

2:00

《米財務省2年債入札》

最高落札利回り・・・0.690%（前回 0.692%）
 最低落札利回り・・・0.593%（前回 0.600%）
 最高利回り落札比率・・・7.97%（前回 44.51%）
 応札倍率・・・3.42倍（前回 3.28倍）

3:20

NY金は、中心限月が前日比0.20ドル安の1オンス=1096.20ドルで取引を終了した。

4:20

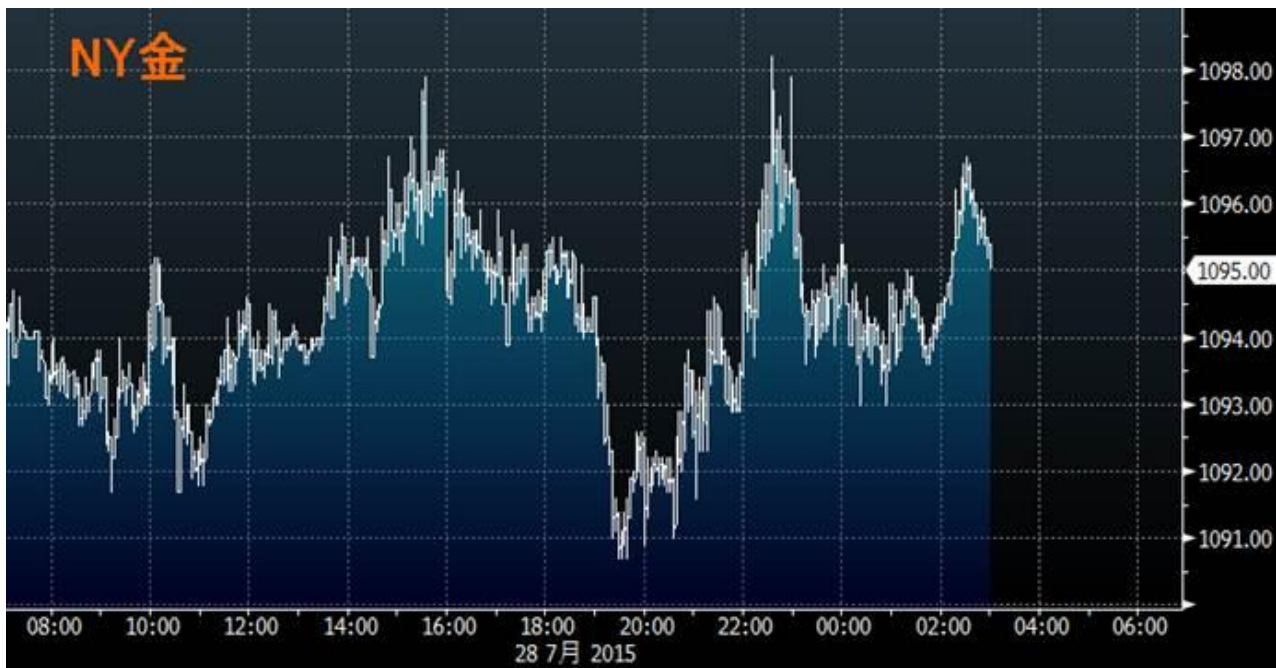
NY原油は、中心限月が前日比0.59ドル高の1バレル=47.98ドルで取引を終了した。

主要商品	終値	前日比
NY GOLD	1096.20	-0.20
NY 原油	47.98	+0.59

（出所：SBILM）

《 NY 金市場 》

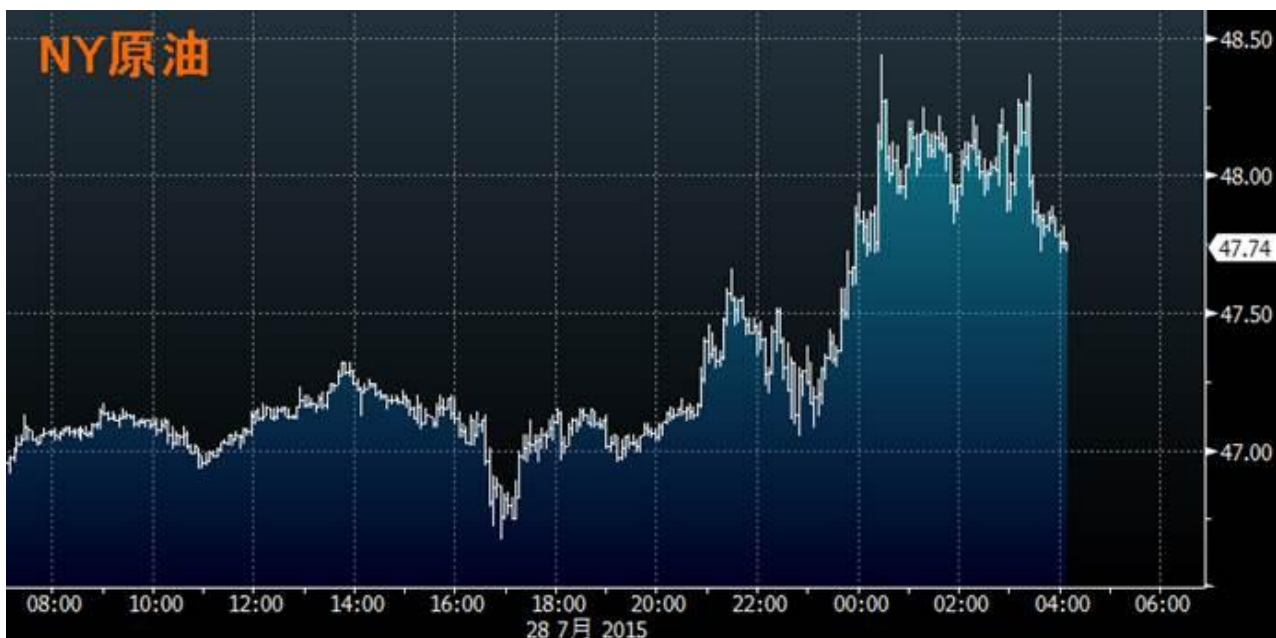
NY金は、米FOMC声明が年内利上げを示唆する可能性があるとの警戒感から、売りがやや優勢となった。ただ、声明の内容を見極めたいとの様子見ムードも強く、値動きはやや限定的となった。



(出所：ブルームバーグ)

◀ NY 原油市場 ▶

NY原油は、前日までの続落で約4ヵ月ぶりの安値水準に値下がりしたことから割安感が広がり、買いが優勢となった。29日に発表される米石油統計で原油在庫が減少するとの一部予想も支援材料となった。



(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	17630.27	+189.68	17650.07	17449.81
S&P500 種	2093.25	+25.61	2095.60	2069.09
ナスダック	5089.21	+49.43	5097.69	5025.61

(出所: SBILM)

《米株式市場》

米株式市場は、ダウや S&P が前日まで 5 営業日連続で値下がりしたため、割安感の出た銘柄を買う動きが先行した。また、欧州の主要株価が上昇したことも好感され、主要株価は堅調な動きが続いた。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 209 ドル高まで上昇する動きとなった。



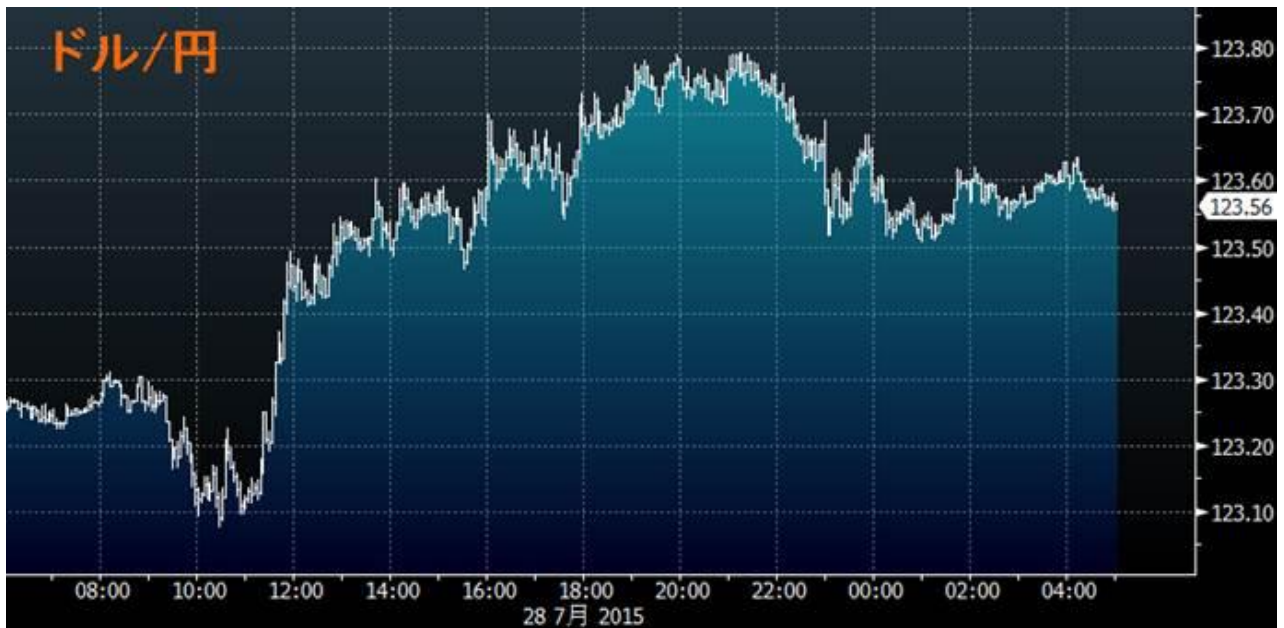
(出所: ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	123.55	123.80	123.51
EUR/JPY	136.61	136.68	136.37
GBP/JPY	192.89	193.04	192.50
AUD/JPY	90.49	90.72	90.18
NZD/JPY	82.47	82.87	82.39
EUR/USD	1.1058	1.1065	1.1024
AUD/USD	0.7324	0.7345	0.7297

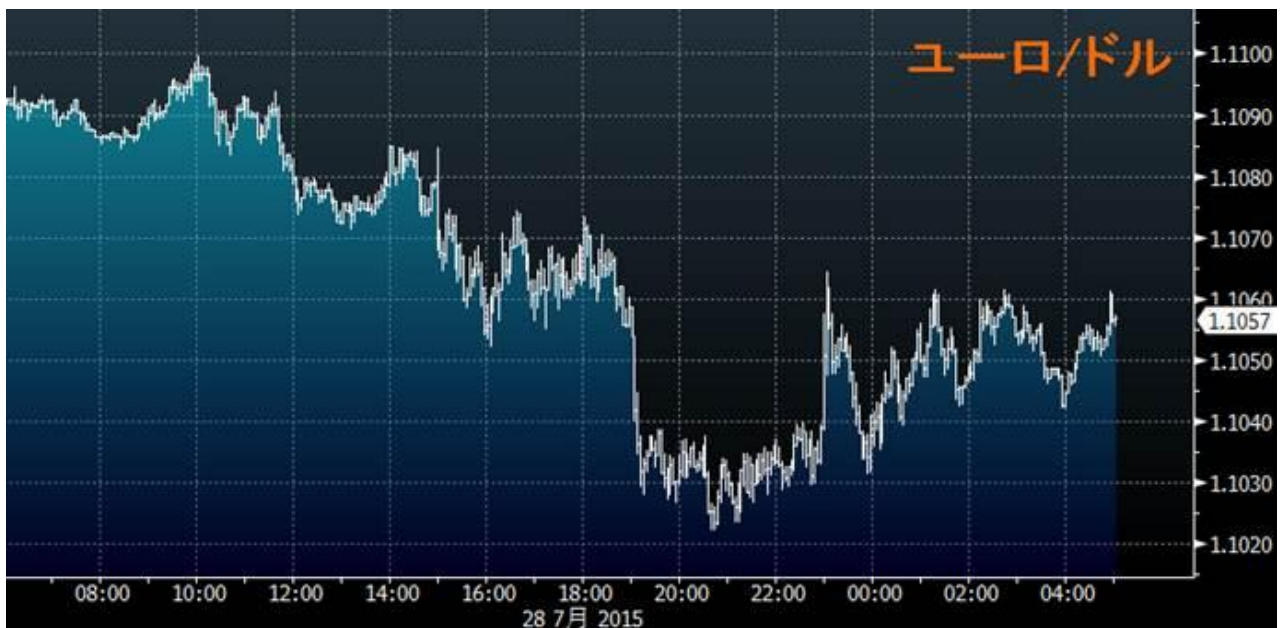
(出所: SBILM)

《外国為替市場》

外国為替市場は、米経済指標が悪化したことから、ドルが主要通貨に対して軟調な動きとなった。ただ、FOMC を控えて様子見ムードも強かったことから、やや下値は限定的となった。そして、欧米の株価が堅調な動きとなったことから、クロス円は堅調な動きも見られた。ただ、全体的には限定的な値動きとなった。



(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。