

### NYマーケットレポート (2015年8月3日)

NY市場では、序盤に発表された米ISM製造業景況指数、建設支出がともに市場予想を下回る結果となったことから、ドルが主要通貨に対して軟調な動きとなった。また、中国の製造業活動の縮小などを背景に、株価や資源価格が下落したことから、リスク回避の動きも見られ、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。そして、資源国通貨は全般的に軟調な動きとなり、特にカナダ・ドルは、政局の先行き不透明感も加わり、対ドルで2004年8月以来の安値を付ける動きとなった。

## 2015/8/3 (月)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	124.18	124.20	123.91
EUR/JPY	136.21	136.44	135.99
GBP/JPY	194.23	194.25	193.61
AUD/JPY	90.55	90.66	90.41
EUR/USD	1.0970	1.0997	1.0965

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	124.28	124.10
EUR/JPY	136.29	135.99
GBP/JPY	194.25	193.44
AUD/JPY	90.63	90.26
EUR/USD	1.0981	1.0943

\*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	20548.11	-37.13
ハンセン指数	24411.42	-224.86
上海総合	3622.91	-40.82
韓国総合指数	2008.49	-21.67
豪ASX200	5679.34	-19.82
インドSENSEX指数	28187.06	+72.50
シンガポールST指数	3192.79	-9.71

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6688.62	-7.66
仏CAC40	5120.52	+37.91
独DAX	11443.72	+134.73
ST欧州600	399.44	+3.07
西IBX35指数	11265.90	+85.20
伊FTSE MIB指数	23714.38	+176.35
南ア 全株指数	51629.67	-423.60

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	123.99	124.28	123.86
EUR/JPY	135.78	136.23	135.59
GBP/JPY	193.21	193.76	193.06
AUD/JPY	90.26	90.45	89.97
NZD/JPY	81.47	82.03	81.36
EUR/USD	1.0952	1.0989	1.0941
AUD/USD	0.7281	0.7291	0.7260

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17598.20	-91.66
S&P500	2098.04	-5.80
NASDAQ	5115.38	-12.90
その他主要株	終値	前日比
🇨🇦 トロント総合	休 場	
🇲🇫 ボルサ指数	44903.95	+151.02
🇲🇻 ボベスパ指数	50138.05	-726.73

\*カナダ市場はCivic Dayで休場

8/4 経済指標スケジュール	
08:50	【日】7月マネタリーベース
09:00	【NZ】7月QV住宅価格
10:00	【NZ】7月ANZ商品価格指数
10:30	【日】6月毎月勤労統計[現金給与総額]
10:30	【豪】6月小売売上高
10:30	【豪】6月貿易収支
13:30	【豪】政策金利発表
15:00	【英】7月ネーションワイド住宅価格
17:30	【英】7月建設業PMI
18:00	【欧】6月生産者物価指数
23:00	【米】8月IBD/TIPP景気楽観指数
23:00	【米】6月製造業受注指数

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1089.40	-5.70
NY 原油	45.17	-1.95
CME コーン	376.50	-4.75
CBOT 大豆	935.50	-4.75

米国債利回り	本 日	前 日
2年債	0.67%	0.67%
3年債	0.97%	0.98%
5年債	1.51%	1.53%
7年債	1.89%	1.92%
10年債	2.15%	2.19%
30年債	2.85%	2.91%

8/4 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 124.28 ユーロ/円 136.00 ユーロ/ドル 1.0945

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	6701.26	+4.98	ダウ 先物ミニ	17621	+7
仏 CAC40	5125.01	+42.40	S&P 500 ミニ	2097.75	-0.75
独 DAX	11435.57	+126.58	NASDAQ 100 ミニ	4583.25	-1.75

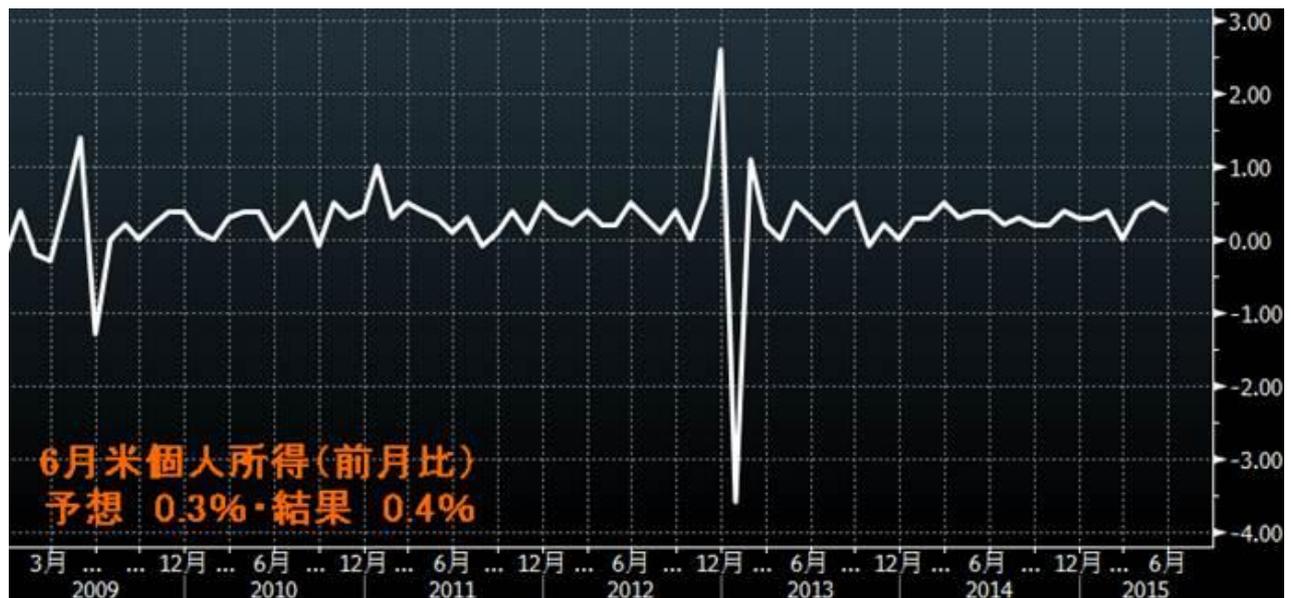
(出所: SBILM)

21:30

◀ 経済指標の結果 ▶

6月米個人所得(前月比) 0.4% (予想 0.3%・前回 0.4%)  
 前回発表の0.5%から0.4%に修正

6月米個人支出(前月比) 0.2% (予想 0.2%・前回 0.7%)  
 前回発表の0.9%から0.7%に修正



(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 ▶

7月シンガポール購買部景気指数 49.7 (予想 50.1 前回 50.4)

7月シンガポール電子産業指数 49.5 (予想 50.0・前回 50.3)



(出所：ブルームバーグ)

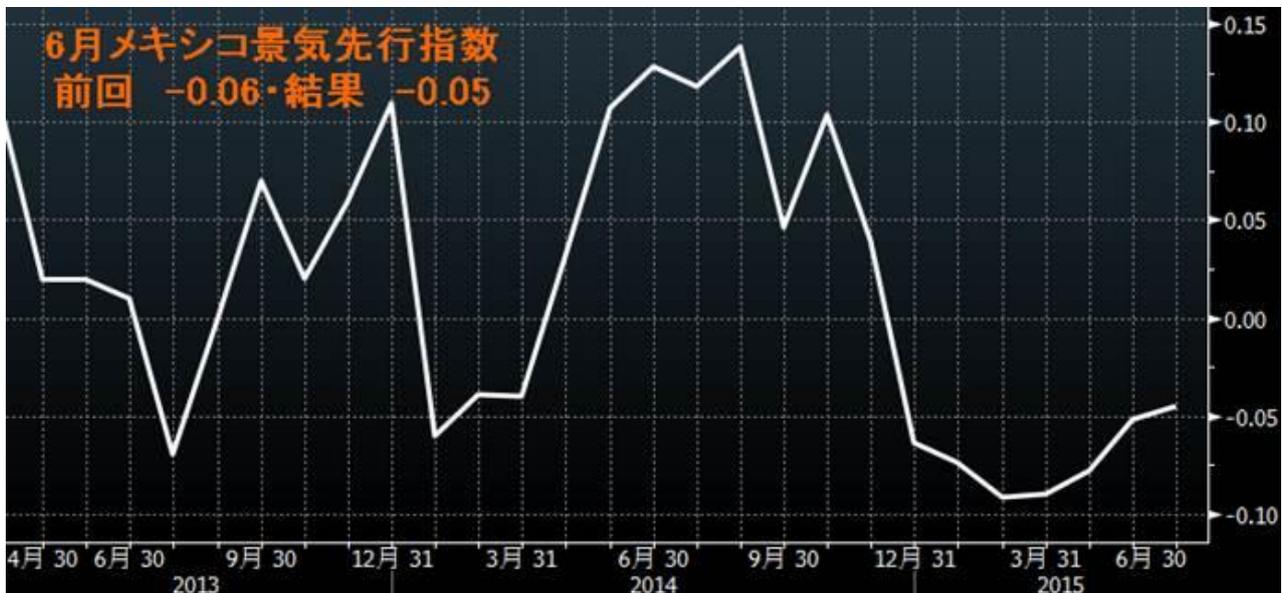


(出所：ブルームバーグ)

22 : 02

◀ 経済指標の結果 ▶

6月メキシコ景気先行指数 -0.05 (前回 -0.06)  
 前回発表の-0.05から-0.06に修正



(出所：ブルームバーグ)

22 : 22

◀ 経済指標の結果 ▶

7月ISM製造業景況指数 52.7 (予想 53.5・前回 53.5)



(出所：ブルームバーグ)

経済指標データ

◀米 ISM 製造業景況指数▶

	7月	6月	5月	4月	3月	2月
景気	52.7	53.5	52.8	51.5	51.5	52.9
価格	44.0	49.5	49.5	40.5	39.0	35.0
生産	56.0	54.0	54.5	56.0	53.8	53.7
新規受注	56.5	56.0	55.8	53.5	51.8	52.5
受注残	42.5	47.0	53.5	49.5	49.5	51.5
入荷遅延	48.9	48.8	50.7	50.1	50.5	54.3
在庫	49.5	53.0	51.5	49.5	51.5	52.5
雇用	52.7	55.5	51.7	48.3	50.0	51.4

22 : 38

米主要株価

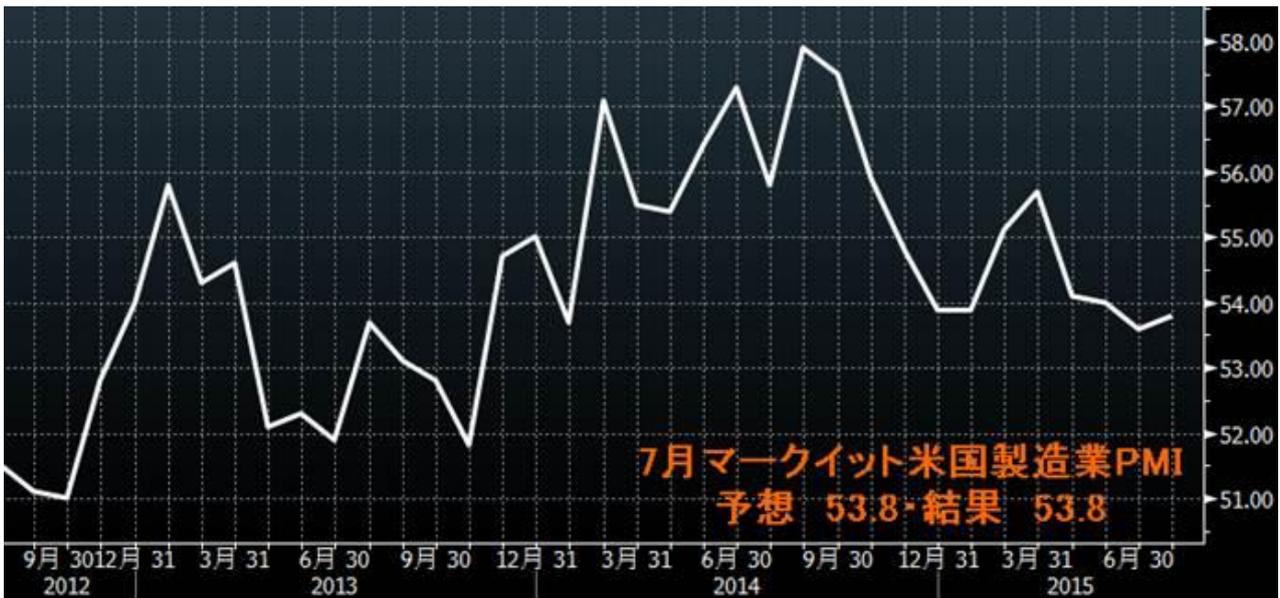
米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17672.52	-17.34
ナスダック	5137.45	+9.17

(出所：SBILM)

22 : 45

◀ 経済指標の結果 ▶

7月マーケット米国製造業 PMI 53.8 (予想 53.8・前回 53.8)

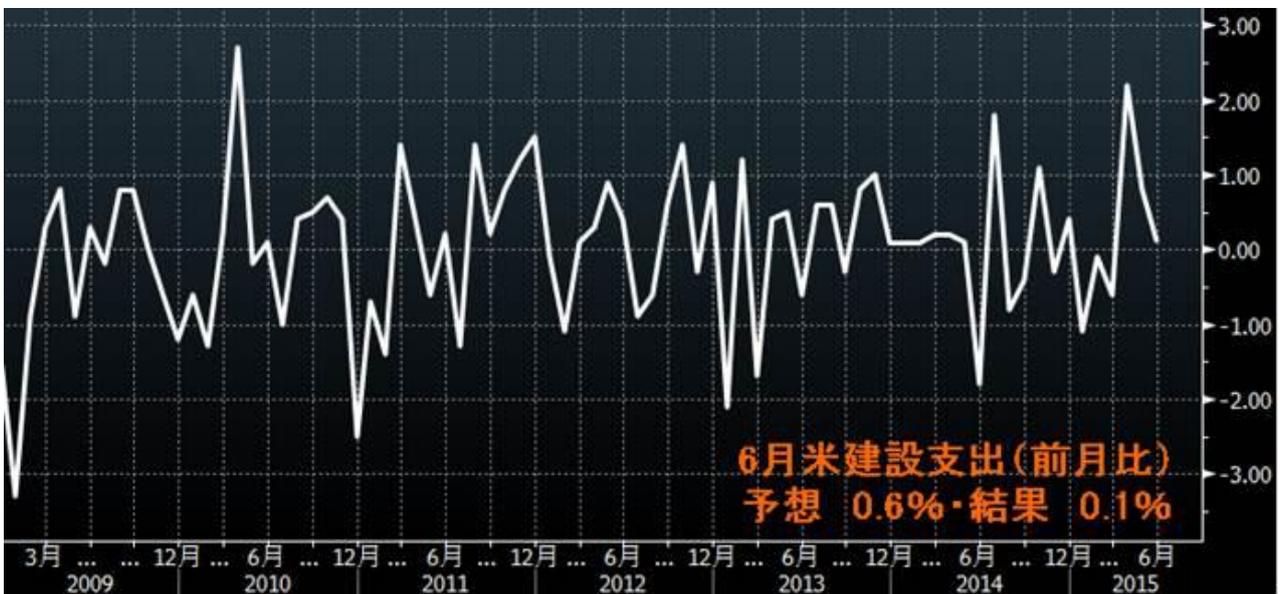


(出所：ブルームバーグ)

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

6月米建設支出(前月比) 0.1% (予想 0.6%・前回 1.8%)  
 前回発表の0.8%から1.8%に修正



(出所：ブルームバーグ)

23 : 30

◀ NY 株式市場 序盤 ▶

序盤の株式市場は、中国の景況指数が悪化したことで、中国経済の先行きに対する不透明感を嫌気した売りが先行した。また、米製造業景況指数が市場予想を下回ったこと圧迫要因となり、主要株価は軟調な動きとなっている。

## ◀ 経済指標のポイント ▶

(1) 6月の米個人所得・消費統計では、個人消費支出が前月比+0.2%と5ヵ月連続で伸び、個人所得も+0.4%となった。米個人消費は、昨年12月から今年1月にかけてマイナスに落ち込んだが、その後は持ち直しの動きが続いている。

①消費では、自動車や家具などの耐久財が-1.3%と4ヵ月ぶりのマイナスとなり、食品やエネルギーなどの非耐久財は+0.4%、サービスも+0.4%となった。

②税金の支払いなどを除いた可処分所得は+0.5%と、昨年11月以来の大きな伸びとなり、貯蓄率も4.8%と前月から0.2ポイント上昇した。

③FRBが物価安定の目安とする個人消費支出（PCE）物価指数は、前年同月比で+0.3%。長期的に達成すべき目標とする2%を引き続き下回った。前月比では+0.2%、変動の激しい食品とエネルギーを除いたPCEコア物価指数は前年同月比+1.3%となった。

(2) 7月の米ISM製造業景況指数は、市場予想の53.5を下回52.7となり、前月からも0.8ポイント低下した。製造業の景気拡大・縮小の阪大基準となる50は31ヵ月連続で上回った。生産が56.0（前月54.0）、新規受注が56.5（56.0）、雇用は52.7（55.5）、在庫は49.5（53.0）、入れ価格は44.0（49.5）と低下した。7月は18業種中11業種が業況拡大を報告。ISMによると、調査対象業界の回答は景況に対する楽観的な見方がある半面、世界的な市場の先行き不透明感や石油価格の下落による影響を懸念する声もあった。

(3) 7月のマークイット米国製造業PMI改定値は、53.8となり市場予想、速報値と一致した。前月に付けた昨年10月以来の低水準である53.6から小幅上昇となった。当該指数は50が景気の判断基準となる。雇用が53.8（前月55.5から）と低下、一方生産は55.3（前月53.9）とから上昇した。

(4) 6月の米建設支出は、年率換算で前月比+0.1%の1兆645億9400万ドルと、市場予想の+0.6%を下回った。金額ベースでは2008年7月（1兆673億8000万ドル）以来、約7年ぶりの高い水準となった。前年同月比では+12.0%。民間部門が減る一方で、公共部門が伸びて全体を押し上げた。

①民間の建設支出は、前月比-0.5%の7663億6600万ドル、前年同月比は+13.7%。民間の内訳は、住宅建設が+0.4%の3715億8900万ドルとなり、2008年5月以来の高い水準。前年同月比は+12.8%。

②住宅以外の建設は、前月比-1.3%の3947億7700万ドルとなり、2013年1月以来の低い伸びだった。前年同月比は+14.6%。宿泊施設や娯楽は伸びたものの、製造業、商業、オフィス向けなどが減少した。

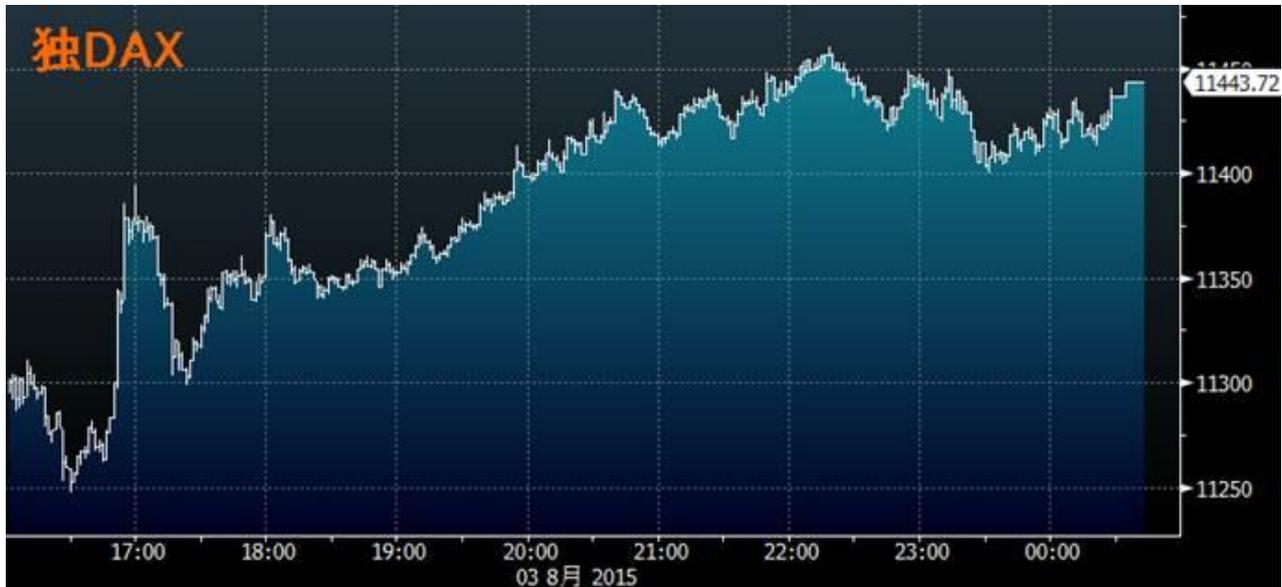
③連邦政府など公共部門の建設支出は、前月比+1.6%の2982億2800万ドルとなり、2010年11月以来の高い水準となった。前年同月比では+8.0%。州・地方政府が前月比+2.2%、連邦政府は-4.7%となった。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6688.62	-7.66
仏 CAC40	5120.52	+37.91
独 DAX	11443.72	+134.73
ストック欧州 600 指数	399.44	+3.07
ユーロファースト 300 指数	1583.52	+11.26
スペイン IBEX35 指数	11265.90	+85.20
イタリア FTSE MIB 指数	23714.38	+176.35
南ア アフリカ全株指数	51629.67	-423.60

(出所: SBILM)

## 《欧州株式市場》

欧州株式市場は、まちまちの結果となった。英 FT100 は、中国の景況指数の悪化を材料に鉱業株を中心に売られたが、独 DAX は、ユーロ圏の景況指数が市場予想を上回ったことが好感された堅調な動きとなった。



(出所：ブルームバーグ)

1:00

米主要株価・中盤

ダウ 17613.30 (-76.56)、S&P500 2103.22 (-0.62) ナスダック 5129.24 (+0.96)

## 《NY債券市場・午前》

序盤のニューヨーク債券市場は、7月の米ISM製造業景況指数が悪化したほか、6月の米建設支出も市場予想を下回ったことで9月の米利上げ観測が後退し、長期債を中心に買いが先行した。

午前の利回りは、30年債が2.89%（前週末2.91%）、10年債が2.18%（2.19%）、7年債が1.92%（1.92%）、5年債が1.53%（1.53%）、3年債が0.98%（0.98%）、2年債が0.67%（0.67%）。

## 《欧州のポイント》

①ギリシャのアテネ証券取引所は、5週間ぶりに売買を再開した。銀行株を中心に売られ、アテネ総合株価指数は取引停止前の最終営業日だった6月26日に比べ一時に約23%下落し、取引時間中としては約3年ぶりの安値をつけた。ギリシャ政府は取引再開に当たって資本流出を抑えるため、国内投資家に対して同国銀行の口座にある預金を使った株式の購入を禁じ、手持ちの現金でのみ購入を可能とした。ギリシャ株の5割超を保有する外国人投資家の売買は制限しない。結局、アテネ総合指数は16%安で引けた。

②ギリシャはECBに対し、国内行に対するELA（緊急流動性支援）枠の引き上げは当面要請しない公算が大きいことが関係筋の話で明らかになった。ギリシャではECBの流動性支援のほか、税収や観光収入の増加などで、銀行流動性バッファは約50億ユーロと、債務危機の最悪期の10億-20億ユーロから増加した。資金流出は比較的低水準にとどまり、7月は純流入が確認できた週もあった。ECBは7月に2回同枠を拡大。現在は約910億ユーロとなっており、このうち約50億ユーロが未使用となっている。

## 7月米自動車販売

フィアット・クライスラーは+6.2% (予想+4.8%)  
 フォードは+5.0% (予想+1.8%)  
 GMは+6.4% (予想+0.6%)

トヨタは+0.6% (予想-0.1%)  
 日産は+7.8% (予想+5.3%)  
 ホンダは+7.7% (予想+4.7%)

### 《ポイント》

7月31日・7月24日・7月17日・7月10日・7月3日・6月26日  
 公的部門・・・248,889・・・237,880・・・227,617・・・216,346・・・204,666・・・193,900  
 資産担保証券ABS・・・9,740・・・9,454・・・9,377・・・9,313・・・8,882・・・8,601  
 カバード債・・・104,003・・・101,686・・・100,175・・・98,246・・・96,058・・・94,567

3:40

NY金は、中心限月が前日比 5.70 ドル安の 1 オンス=1089.40 ドルで取引を終了した。

4:15

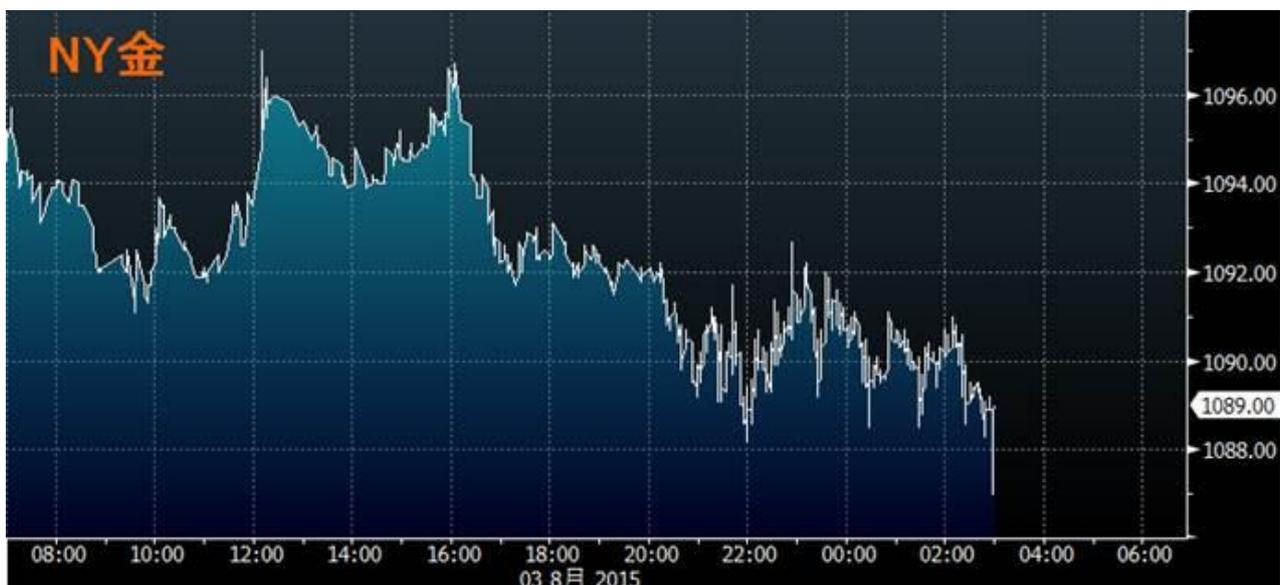
NY原油は、中心限月が前日比 1.95 ドル安の 1 バレル=45.17 ドルで取引を終了した。

主要商品	終値	前日比
NY GOLD	1089.40	-5.70
NY 原油	45.17	-1.95

(出所:SBILM)

### 《 NY 金市場 》

NY金は、ドルがユーロで上昇したのにつれて、ドルの代替資産とされる金を売る動きが優勢となった。また、年内の米利上げに対する警戒感から金を売却する動きも見られた。



(出所:ブルームバーグ)

### ◀ NY 原油市場 ▶

NY原油は、中国や米国の製造業関連の景況指数がいずれも低下したことを受けて、世界景気が減速すればエネルギー需要が落ち込むとの懸念が広がり、売りが優勢となった。終値ベースでは、3月中旬以来約4ヵ月半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	17598.20	-91.66	17704.76	17496.61
S&P500 種	2098.04	-5.80	2105.70	2087.31
ナスダック	5115.38	-12.90	5143.08	5082.32

(出所：SBILM)

### ◀ 米株式市場 ▶

米株式市場は、中国の景況指数が悪化したことで、中国経済の先行きに対する不透明感を嫌気した売りが先行した。また、米製造業景況指数や建設関連の指標が市場予想を下回ったことも圧迫要因となり、主要株価は軟調な動きが続いた。ダウ平均株価は、序盤から軟調な展開が続き、一時193ドル安まで下げる場面もあった。



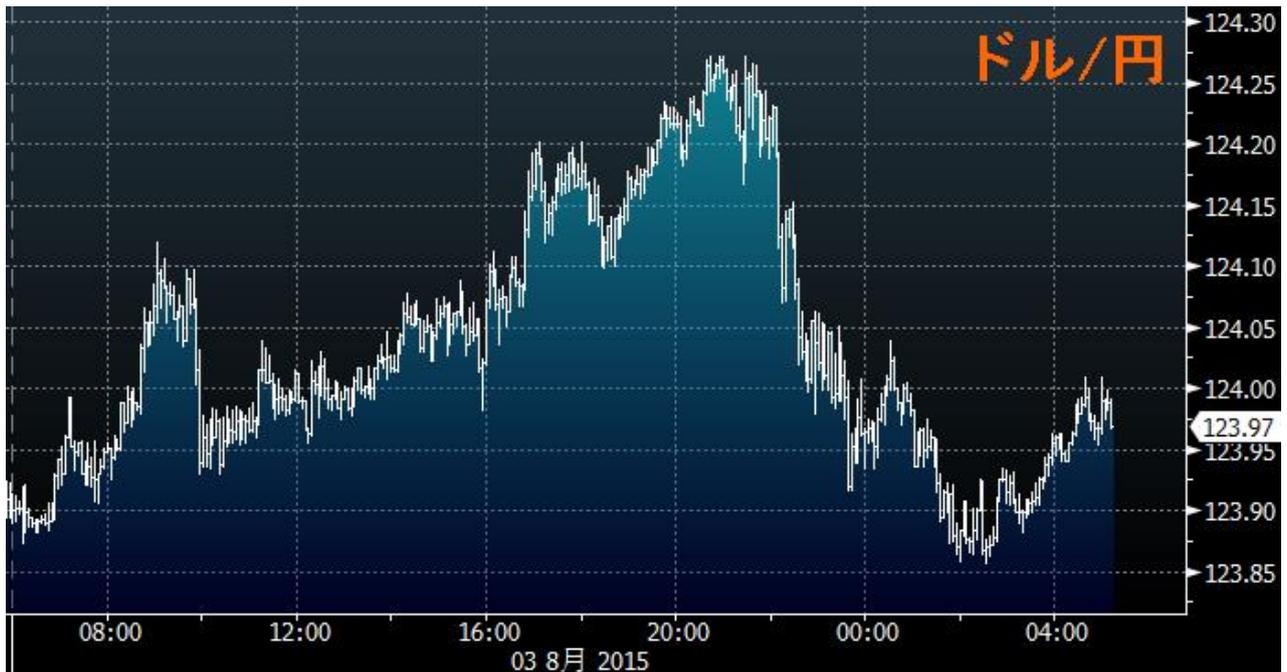
(出所：ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	123.99	124.28	123.86
EUR/JPY	135.78	136.23	135.59
GBP/JPY	193.21	193.76	193.06
AUD/JPY	90.26	90.45	89.97
NZD/JPY	81.47	82.03	81.36
EUR/USD	1.0952	1.0989	1.0941
AUD/USD	0.7281	0.7291	0.7260

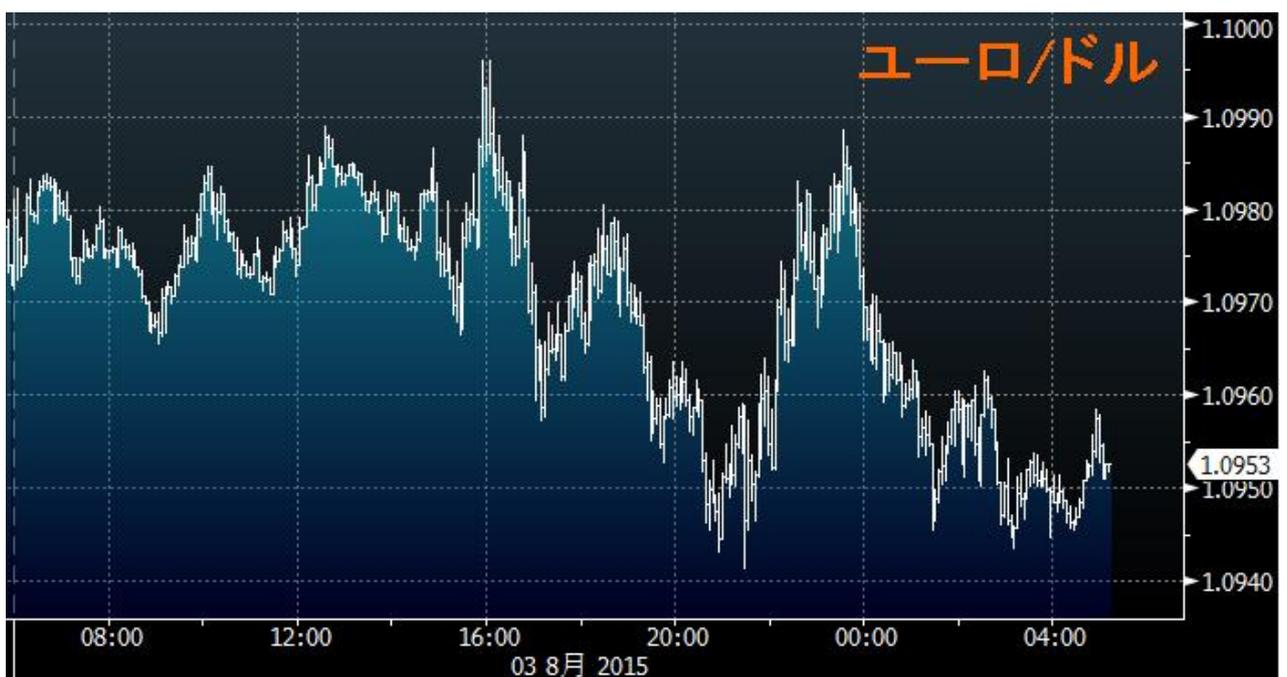
(出所：SBILM)

#### 《外国為替市場》

外国為替市場は、米製造業、建設関連の経済指標が予想を下回る結果となったことから、ドルが主要通貨に対して軟調な動きとなった。また、米株価が下落したことから、円を買う動きが強まり、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。ただ、終盤には株価が下げ幅を縮小したことから、やや値を戻す動きも見られた。



(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。