

NY マーケットレポート (2016年6月29日)

NY 市場では、英国の EU 離脱問題を巡る投資家の不安が和らぎ、リスク回避の動きが弱まったことから、欧米の株価が大幅上昇となり、これを受けてドル円・クロス円は序盤から堅調な動きとなった。そして、終盤には、原油価格の大幅上昇や、米長期債利回りの上昇を受けて、円売りが優勢となり、ドル円・クロス円は一段の上昇となった。英ポンドは、欧州株高に加えて、EU 側が離脱交渉入りについて、英国で次期首相が決まる見通しの 9 月以降への先送りを、事実上受け入れたとの見方も下支え要因となり、ドルや円に対して堅調な動きとなった。

2016年6月29日 (水)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	102.43	102.78	102.19
EUR/JPY	113.40	113.85	112.95
GBP/JPY	137.17	137.34	135.89
AUD/JPY	75.95	76.04	75.45
EUR/USD	1.1073	1.1104	1.1049

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	102.74	102.38
EUR/JPY	114.00	113.23
GBP/JPY	138.14	136.86
AUD/JPY	76.45	75.80
EUR/USD	1.1097	1.1052

*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	15566.83	+243.69
ハンセン指数	20436.12	+263.66
上海総合	2931.59	+19.03
韓国総合指数	1956.36	+20.14
豪ASX200	5142.40	+39.12
インドSENSEX指数	26740.39	+215.84
シンガポールST指数	2792.73	+36.20

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6360.06	+219.67
仏CAC40	4195.32	+106.47
独DAX	9612.27	+164.99
STX欧州600	326.49	+9.79
西IBEX35指数	8105.30	+270.30
伊FTSE MIB指数	15946.93	+345.31
南ア 全株指数	51890.42	+749.28

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	102.94	102.95	102.51
EUR/JPY	114.50	114.50	113.76
GBP/JPY	138.58	139.03	137.59
AUD/JPY	76.66	76.67	76.11
NZD/JPY	73.22	73.30	72.85
EUR/USD	1.1124	1.1131	1.1074
AUD/USD	0.7448	0.7457	0.7417

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17694.68	+284.96
S&P500	2070.77	+34.68
NASDAQ	4779.25	+87.38
日経225 (CME)	15740	+185
トロント総合	14036.74	+194.05
ボルサ指数	45466.37	+751.83
ボベスパ指数	51003.42	+996.86

6/30 経済指標スケジュール

08:05	【英国】6月GFK消費者信頼感調査
08:50	【日本】5月鉱工業生産
10:00	【ニュージーランド】6月ANZ企業景況感
14:00	【日本】5月住宅着工戸数・5月建設工事受注
15:00	【ドイツ】5月小売売上高指数
15:45	【フランス】5月生産者物価指数・6月消費者物価指数
15:45	【フランス】5月消費者支出
16:00	【トルコ】5月貿易収支
16:00	【スイス】6月KOF先行指数
16:55	【ドイツ】6月失業率・6月失業者数
17:30	【香港】5月小売売上高
17:30	【英国】1Q GDP
17:30	【英国】1Q経常収支
18:00	【欧州】6月消費者物価指数
18:30	【南アフリカ】5月生産者物価指数
21:00	【南アフリカ】5月財政収支・5月貿易収支
21:30	【米国】失業保険継続受給者数
21:30	【米国】新規失業保険申請件数
21:30	【カナダ】4月GDP
21:30	【カナダ】5月鉱工業製品価格・5月原料価格指数
22:45	【米国】6月シカゴ購買部協会景気指数
03:00	【メキシコ】メキシコ政策金利発表

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1326.90	+9.00
NY 原油	49.88	+2.03
CMEコーン	377.75	-11.00
CBOT 大豆	1112.50	-7.75

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.63%	0.61%
3年債	0.74%	0.71%
5年債	1.05%	1.00%
7年債	1.32%	1.26%
10年債	1.51%	1.46%
30年債	2.32%	2.28%

6/30 主要会議・講演・その他予定

・セントルイス連銀総裁 講演

NY市場レポート

21:00

ドル/円 102.74 ユーロ/円 113.89 ユーロ/ドル 1.1085

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	6268.41	+128.02	ダウ 先物ミニ	17404	+103
仏 CAC40	4186.72	+97.87	S&P 500 ミニ	2041.00	+12.50
独 DAX	9598.29	+151.01	NASDAQ 100 ミニ	4311.00	+30.00

出所：SBILM

21:00

◀ 経済指標の結果 ▶

6月ドイツ消費者物価指数（前月比） 0.1%（予想 0.2%・前回 0.3%）

6月ドイツ消費者物価指数（前年比） 0.3%（予想 0.3%・前回 0.1%）

6月ドイツEU基準消費者物価指数（前月比） 0.1%（予想 0.1%・前回 0.4%）

6月ドイツEU基準消費者物価指数（前年比） 0.2%（予想 0.2%・前回 0.0%）



出所：Bloomberg



出所：Bloomberg

21 : 05

◀ 要人発言 ▶

メルケル独首相

・「EU、英国に可及的速やかな離脱申請望む」

21 : 30

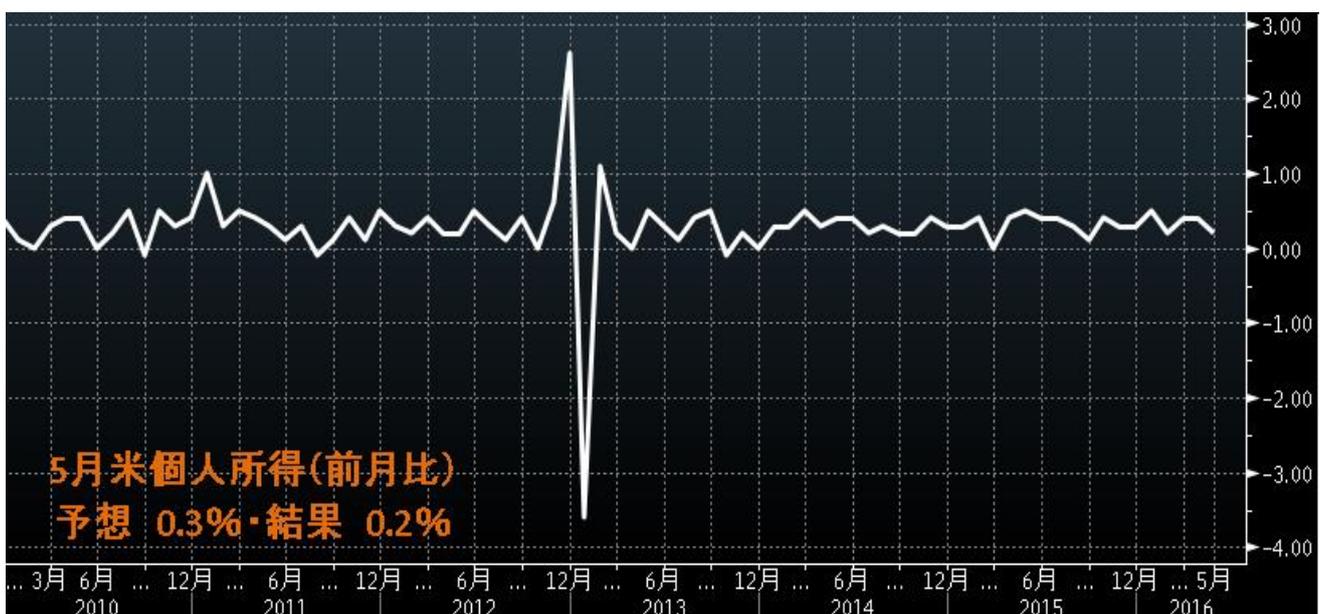
◀ 経済指標の結果 ▶

5月米個人所得(前月比) 0.2% (予想 0.3%・前回 0.5%)

前回発表の0.4%から0.5%に修正

5月米個人支出(前月比) 0.4% (予想 0.4%・前回 1.1%)

前回発表の1.0%から1.1%に修正



出所：Bloomberg



出所：Bloomberg

指標結果データ

≪米個人所得・支出≫

	5月	4月	3月	2月	1月	12月
個人所得	0.2	0.5	0.3	-0.1	0.4	0.3
賃金・給与	0.2	0.5	0.3	-0.0	0.6	0.3
可処分所得	0.2	0.5	0.4	-0.1	0.6	0.3
個人消費支出	0.4	1.1	0.0	-0.2	0.1	0.1
個人貯蓄率	5.3	5.4	6.0	5.7	5.7	5.3

21:30

≪ 経済指標の結果 ≫

5月米 PCE デフレーター (前年比) 0.9% (予想 1.0%・前回 1.1%)
 5月米 PCE コア・デフレーター (前月比) 0.2% (予想 0.2%・前回 0.2%)
 5月米 PCE コア・デフレーター (前年比) 1.6% (予想 1.6%・前回 1.6%)



出所：Bloomberg



出所：Bloomberg

22 : 33

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17557.63	+147.91
ナスダック	4739.70	+47.84

出所：SBILM

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

5月米中古住宅販売仮契約(前月比) -3.7% (予想 -1.1%・前回 3.9%)

前回発表の5.1%から3.9%に修正

5月米中古住宅販売仮契約(前年比) 2.4% (予想 4.6%・前回 1.8%)

前回発表の2.9%から1.8%に修正



出所：Bloomberg



出所：Bloomberg

経済指標データ

《中古住宅販売仮契約》

	5月	4月	3月	2月	1月	12月
全米	-3.7	3.9	1.6	3.4	-3.0	0.9
北東部	-5.3	1.2	3.2	-0.2	-3.5	5.9
中西部	-4.2	-0.8	0.9	11.4	-4.9	0.3
南部	-3.1	4.1	3.0	1.5	-0.7	0.3
西部	-3.4	11.4	-1.8	1.4	-5.2	-1.0

(前月比%)

	5月	4月	3月	2月	1月	12月
全米	2.4	1.8	3.2	5.0	-1.5	3.1
北東部	2.7	10.3	18.7	17.5	9.1	13.0
中西部	1.8	0.7	5.3	7.2	-0.5	2.9
南部	2.7	0.6	1.5	3.0	4.5	0.9
西部	2.1	-1.0	-5.7	-1.0	2.5	2.1

(前年比%)

23 : 30

《EIA 米週間在庫統計》

原油在庫・・・405 万バレル減少
ガソリン在庫・・・137 万バレル増加
留出油在庫・・・180 万バレル減少

23 : 35

《 NY 株式市場 序盤》

序盤の株式市場は、英国の EU 離脱問題に対する投資家の不安が後退し、アジアや欧州の主要株価が軒並み上昇したことが材料視され、主要株価は序盤から堅調な動きとなった。また、5 月の米個人支出が堅調な伸びを示したことも好感された。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きが続き、一時前日比 188 ドル高まで上昇した。

◀ 経済指標のポイント ▶

(1) 5月の米個人所得・消費統計では、個人支出が前月比+0.4%となり、7年ぶりの大幅な伸びとなった前月から減速したものの、比較的堅調な伸びを維持した。一方、個人所得は+0.2%と3ヵ月ぶりの低い伸びとなった。

①個人支出は、自動車などの耐久財が+0.3%と2ヵ月連続の増加、食品・エネルギーなどの非耐久財は+0.6%で3ヵ月連続のプラス、サービスは+0.4%となった。

②税金の支払いを除いた可処分所得は+0.2%となり、貯蓄率は5.3%と前月から0.1ポイント低下した。

③FRBが物価安定の目安とする5月の個人消費支出（PCE）物価指数は、前年同月比+0.9%となり、目標の2%を引き続き下回った。また、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+1.6%となった。

(2) NAR（全米不動産業者協会）が発表した5月の中古住宅販売仮契約指数は、前月比-3.7%の110.8（2001年=100）となり、4ヵ月ぶりにマイナスに低下した。前年同月比では-0.2%の低下となり、2014年8月以来、21ヵ月ぶりのマイナスとなった。

①地域別では、北東部が-5.3%、中西部が-4.2%、南部が-3.1%、西部が-3.4%と軒並みマイナスとなった。

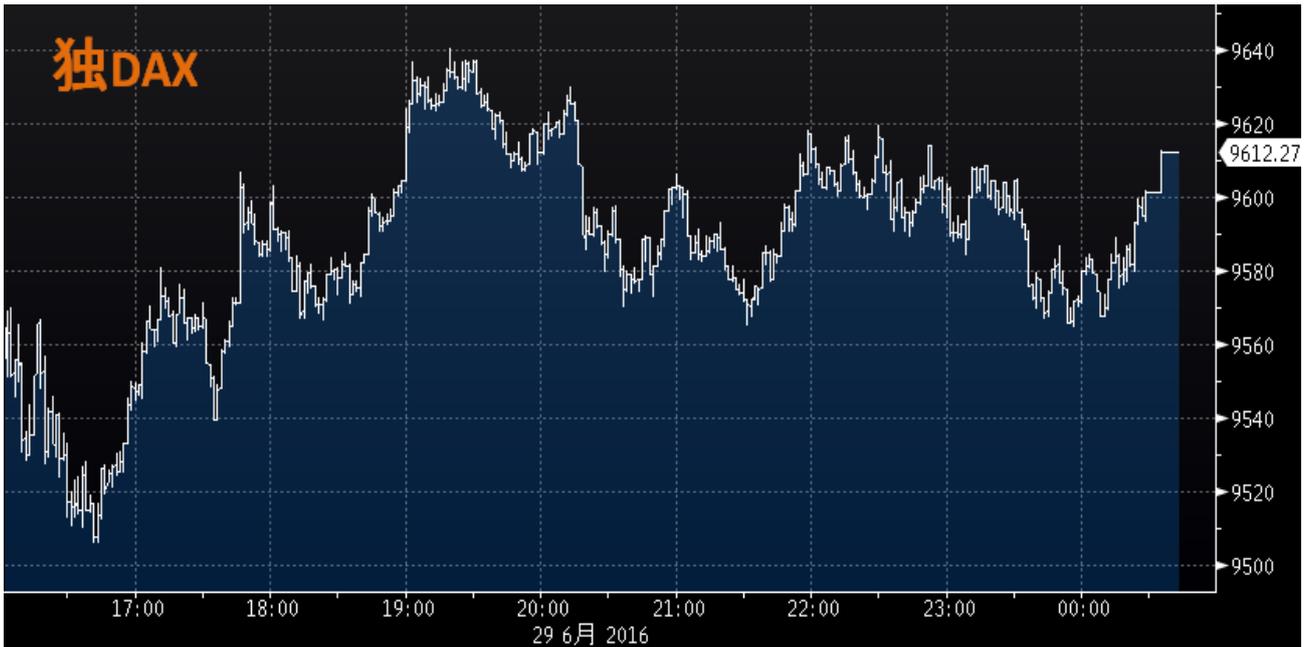
②7月の中古住宅販売見通しによると、2016年の販売件数は、前年比+3.7%の544万3000件となった。2017年は+2.5%の558万件を見込んでいる。中古住宅の中間販売価格の見通しは2016年が前年比+4.5%の23.25万ドル。2017年は+3.2%の23.99万ドルと予測した。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6360.06	+219.67
仏 CAC40	4195.32	+106.47
独 DAX	9612.27	+164.99
ストック欧州 600 指数	326.49	+9.79
ユーロファースト 300 指数	1290.86	+38.37
スペイン IBEX35 指数	8105.30	+270.30
イタリア FTSE MIB 指数	15946.93	+345.31
南ア アフリカ全株指数	51890.42	+749.28

出所：SBILM

◀ 欧州株式市場 ▶

欧州株式市場は、英国のEU離脱問題に対する不安がやや後退し、主要株価は大幅続伸となった。



1:00

米主要株価・中盤

ダウ 17638.70 (+228.98)、S&P500 2062.97 (+26.88) ナスダック 4767.92 (+76.05)

◀ NY 債券市場 ・ 午前 ▶

序盤のニューヨーク債券市場は、英国の EU 離脱が世界経済に悪影響を及ぼすとの根強い懸念から長期債を中心に買いが先行した。ただ、米株式相場の上昇を背景とした売りも出た。

午前の利回りは、30年債が 2.25% (前日 2.28%)、10年債が 1.46% (1.47%)、7年債が 1.27% (1.27%)、5年債が 1.01% (1.01%)、3年債が 0.72% (0.71%)、2年債が 0.62% (0.62%)。

◀ 欧州のポイント ▶

- ① 国民投票で EU 離脱を選んだ英国に関するエコノミスト調査によると、回答者のほぼ 4 分の 3 が英経済のリセッション入りを予想。また、過半数は英中銀が 7-9 月に利下げをすると予想した。金利先物市場では、7 月の利下げ確率 37% を織り込み、8 月の利下げ確率は 56% を織り込む水準で推移している。
- ② EU は、英国の EU 離脱問題を主要議題とする首脳会議をブリュッセルで開いた。キャメロン英首相が、会議で国民投票の離脱の結果を説明したが、正式通知をしなかったため、29 日は英国を除く 27 カ国による非公式会議とし、今後の方針を確認した。英国国民投票後、27 カ国首脳のみで集まるのは初めて。離脱を決めた歴史的国民投票から 30 日で 1 週間。英国抜きの EU の枠組みが始動した。欧州統合の将来に関する検討も始まった。
- ③ 英北部スコットランド行政政府のスタージョン首相は、ブリュッセルを訪問し、EU 欧州議会のシュルツ議長と会談した。スタージョン氏は会談後「スコットランドは EU にとどまる決意だ」と表明した。スタージョン氏は英国の EU 離脱が決まったことを受けて、スコットランドが独立し、EU に独自加盟する可能性を探っている。シュルツ氏はスタージョン氏の「意見を聞いた」と述べた。貿易などを通じて EU とつながりが深いスコットランドでは、23 日の国民投票で残留支持が多数を占めた。独立の是非を問う 2014 年の住民投票で残留の結果が出ているが、スタージョン氏はあらためて住民投票を行うことを検討している。
- ④ ラホイ・スペイン暫定首相は、スコットランドの EU 加盟可能性をめぐる交渉に反対の立場を強調した。記者会見で「本当に明確にしておきたいのは、スコットランドには EU と交渉を行う力量が無いということだ。英国政府以外の相手との交渉にスペインは反対だ」と述べた。「英国が離脱すれば、スコットランドも去る」と語った。

4 : 15

NY 金は、中心限月が前日比 9.00 ドル高の 1 オンス=1326.90 ドルで取引を終了した。

4 : 20

NY 原油は、中心限月が前日比 2.03 ドル高の 1 バレル=49.88 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1326.90	+9.00
NY 原油	49.88	+2.03

出所 : SBILM

◀ NY 金市場 ▶

NY 金は、英国 EU 離脱問題により、米 FRB による追加利上げのペースが一段と緩やかになるとの見方から、金先物に資金が流入した。また、ドルがユーロなどに対して下落し、ドルの代替資産としての金に買いが入ったことも支援材料となった。終値ベースでは、2014 年 7 月以来の高水準となった。



出所 : Bloomberg

◀ NY 原油市場 ▶

NY 原油は、EIA（米エネルギー情報局）が発表した米石油統計で原油在庫が市場予想を大幅に上回る減少となったため、供給過剰感が後退して買いが広がった。油田で大規模なストライキが起きるとの観測が浮上しているノルウェーや、経済危機にあるベネズエラなど、一部産油国で生産量が減るとの見方も相場を下支えた。



出所：Bloomberg

主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	17694.68	+284.96	17704.51	17456.02
S&P500 種	2070.77	+34.68	2073.13	2042.69
ナスダック	4779.25	+87.38	4787.59	4732.34

出所：SBILM

《米株式市場》

米株式市場は、英国のEU離脱問題に対する投資家の不安が後退し、アジアや欧州の主要株価が軒並み上昇したことが材料視され、主要株価は序盤から堅調な動きとなった。また、5月の米個人支出が堅調な伸びを示したことも好感された。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きが続き、終盤には一時前日比294ドル高まで上昇する場面もあった。



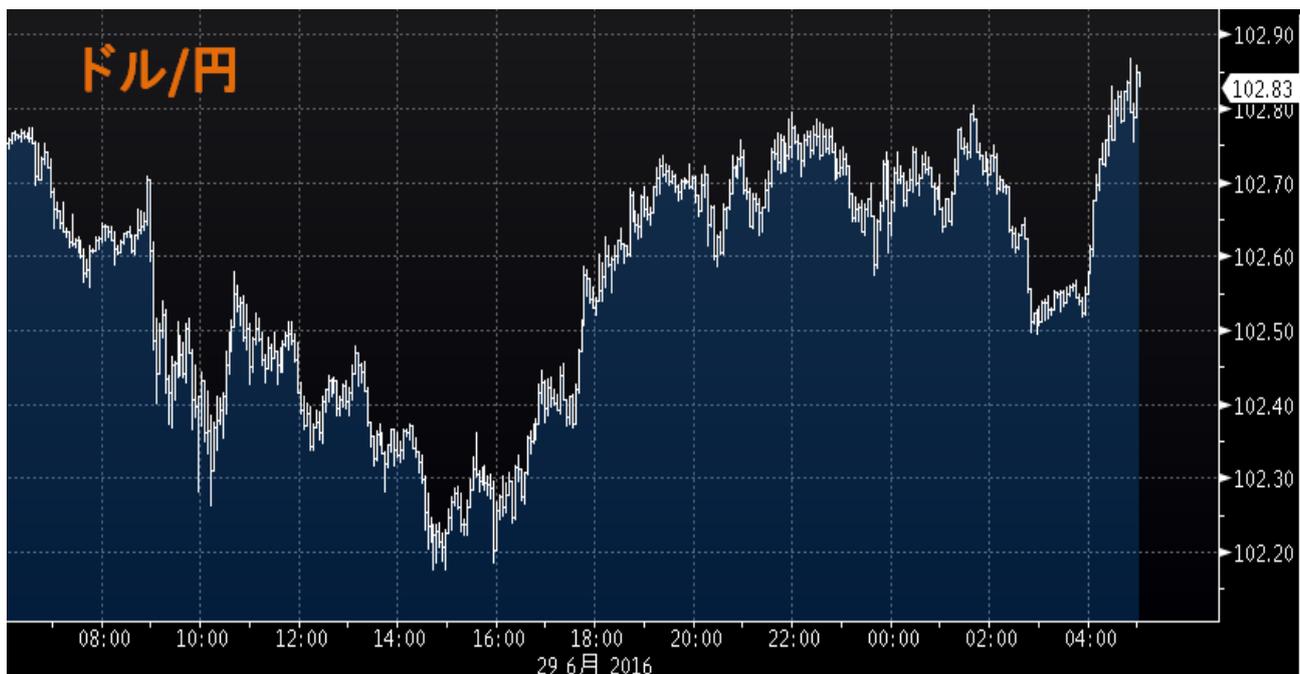
出所：Bloomberg

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	102.94	102.95	102.51
EUR/JPY	114.50	114.50	113.76
GBP/JPY	138.58	139.03	137.59
AUD/JPY	76.66	76.67	76.11
NZD/JPY	73.22	73.30	72.85
EUR/USD	1.1124	1.1131	1.1074
AUD/USD	0.7448	0.7457	0.7417

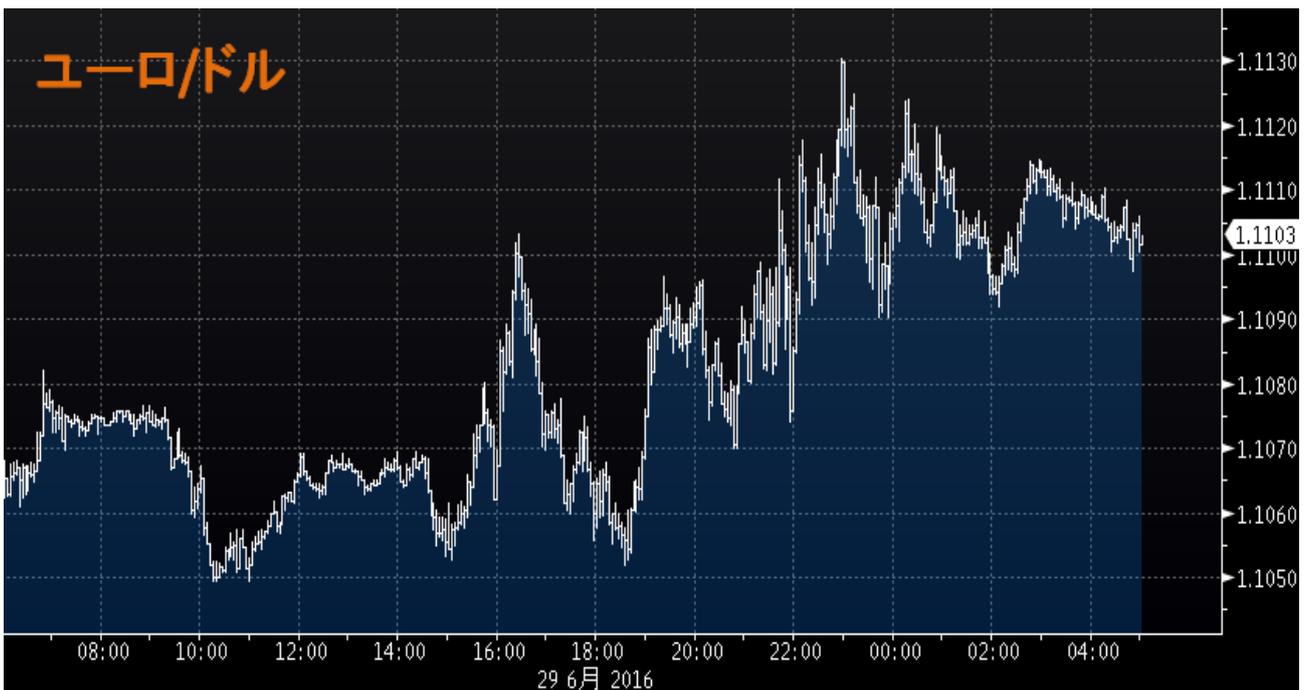
出所：SBILM

《外国為替市場》

外国為替市場は、欧米の堅調な株価を受けて、ドル円・クロス円は序盤から堅調な動きとなった。午後には一時反落となったものの、終盤には再び円売りが優勢となり、ドル円・クロス円は堅調な動きとなった。



出所：Bloomberg



出所：Bloomberg

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。