

NYマーケットレポート (2016年7月1日)

NY市場では、欧米の株価上昇を受けて、序盤のドル円・クロス円は比較的堅調な動きとなった。また、米ISM製造業景況指数が市場予想を上回り、2015年2月以来、1年4ヵ月ぶりの高水準となったことで、ドルは主要通貨に対して堅調な動きとなった。一方、米ダウ平均株価は、序盤に6月23日以来の18000ドル台まで上昇したが、上値の重い動きとなり、ここから反落する動きとなった。この動きを受けて、ドル円・クロス円も一段の下落となった。また、米国の3連休を控えて積極的な売買が手控えられていたこともあり、全般的に限定的な動きとなった。

2016年7月1日 (金)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	102.55	103.40	102.46
EUR/JPY	113.90	114.75	113.69
GBP/JPY	136.34	137.69	136.10
AUD/JPY	76.52	76.95	76.43
EUR/USD	1.1108	1.1117	1.1072

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	102.70	102.48
EUR/JPY	114.29	113.74
GBP/JPY	136.71	135.97
AUD/JPY	76.87	76.49
EUR/USD	1.1139	1.1094

*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	15682.48	+106.56
ハンセン指数	20794.37	+358.25
上海総合	2932.48	+2.87
韓国総合指数	1987.32	+16.97
豪ASX200	5246.61	+13.23
インドSENSEX指数	27144.91	+145.19
シンガポールST指数	2846.37	+5.44

欧州主要株価	終値	前日比
英FT100	6577.83	+73.50
仏CAC40	4273.96	+36.48
独DAX	9776.12	+96.03
STX欧州600	332.24	+2.36
西IBEX35指数	8268.90	+105.60
伊FTSE MIB指数	16295.78	+98.00
南ア 全株指数	52357.50	+139.78

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	102.58	102.74	102.46
EUR/JPY	114.19	114.58	113.99
GBP/JPY	136.15	136.86	135.77
AUD/JPY	76.86	76.96	76.67
NZD/JPY	73.48	73.83	73.38
EUR/USD	1.1133	1.1170	1.1113
AUD/USD	0.7493	0.7504	0.7474

米主要株価	終値	前日比
米ダウ平均	17949.37	+19.38
S&P500	2102.95	+4.09
NASDAQ	4862.57	+19.89
日経225 (CME)	15560	-180
トロント総合	休 場	
ボルサ指数	46213.27	+246.78
ボベスパ指数	52233.04	+706.12

カナダ市場はCanada Dayのため休場

7/4 経済指標スケジュール

08:50	【日本】6月マネタリーベース
10:30	【オーストラリア】5月住宅建設許可件数
10:30	【オーストラリア】6月ANZ求人広告件数
16:00	【トルコ】6月生産者物価指数
16:00	【トルコ】6月消費者物価指数
17:30	【英国】6月建設業PMI
17:30	【欧州】7月センチックス投資家信頼感
18:00	【欧州】5月生産者物価指数
19:00	【南アフリカ】1Q非農業部門雇用者数
22:00	【シンガポール】6月購買部景気指数
22:00	【シンガポール】6月電子産業指数
22:30	【カナダ】6月RBCカナダ製造業PMI
23:30	【カナダ】2Q企業景況感調査

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1339.00	+18.40
NY 原油	48.99	+0.66
CME コーン	360.00	-5.50
CBOT 大豆	1137.50	-15.75

米債利回り	本日	前日
2年債	0.59%	0.59%
3年債	0.69%	0.70%
5年債	1.00%	1.01%
7年債	1.26%	1.29%
10年債	1.44%	1.48%
30年債	2.23%	2.29%

7/4 主要会議・講演・その他予定

- ・ 欧州議会本会議 (～7日)
- ・ 米国市場休場 (米独立記念日)

NY 市場レポート

21:00

ドル/円 102.63 ユーロ/円 114.14 ユーロ/ドル 1.1120

21:00

欧州株式市場・米株価指数先物

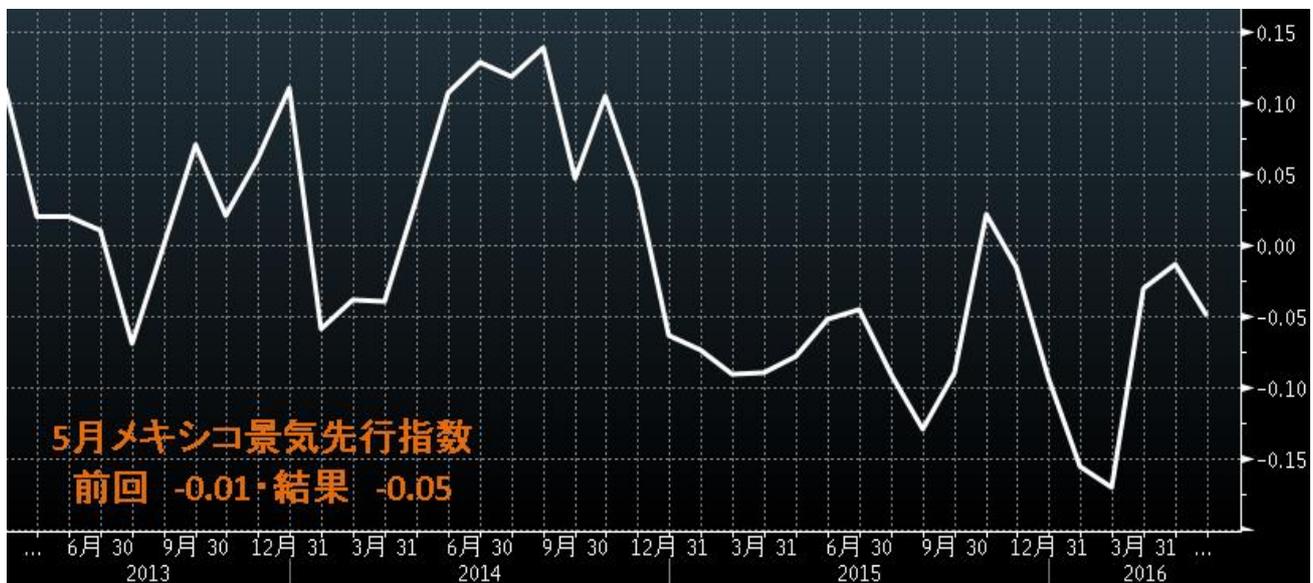
欧州主要株価	株価	前日比	米株価先物	株価	前日比
英 FT100	6363.06	+58.73	ダウ 先物ミニ	17831	+12
仏 CAC40	4274.51	+37.03	S&P 500 ミニ	2090.75	+0.50
独 DAX	9757.68	+77.59	NASDAQ 100 ミニ	4407.75	+0.75

出所：SBILM

22:00

◀ 経済指標の結果 ▶

5月メキシコ景気先行指数 -0.05 (前回 -0.01)



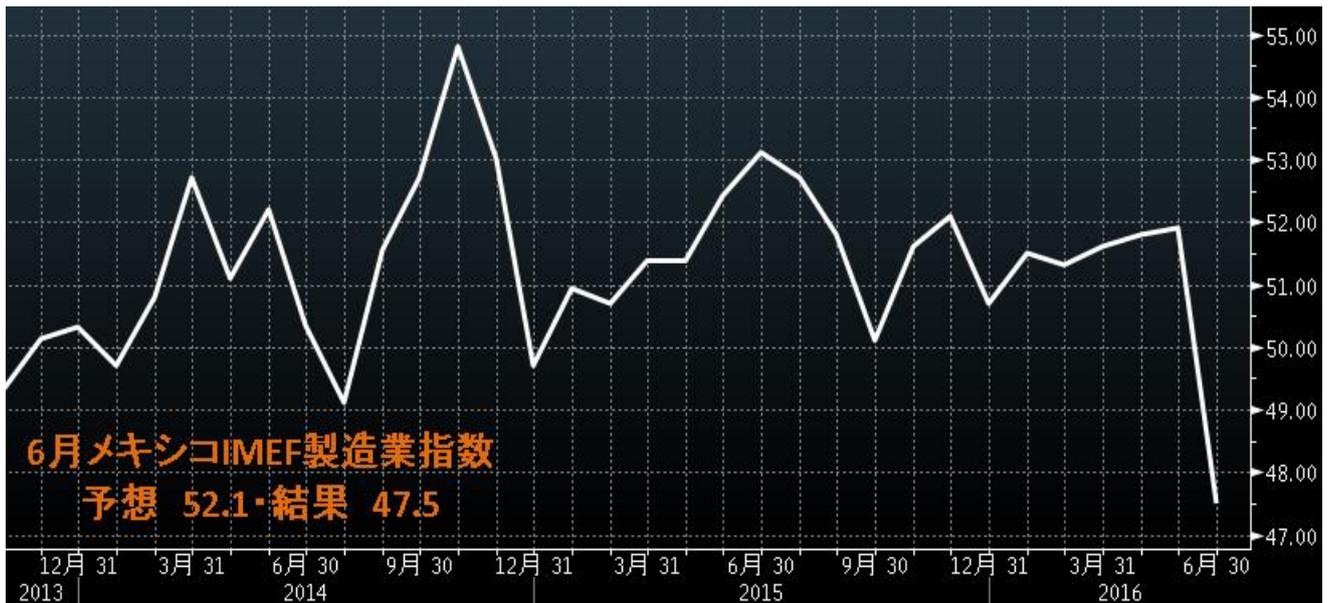
出所：Bloomberg

22:00

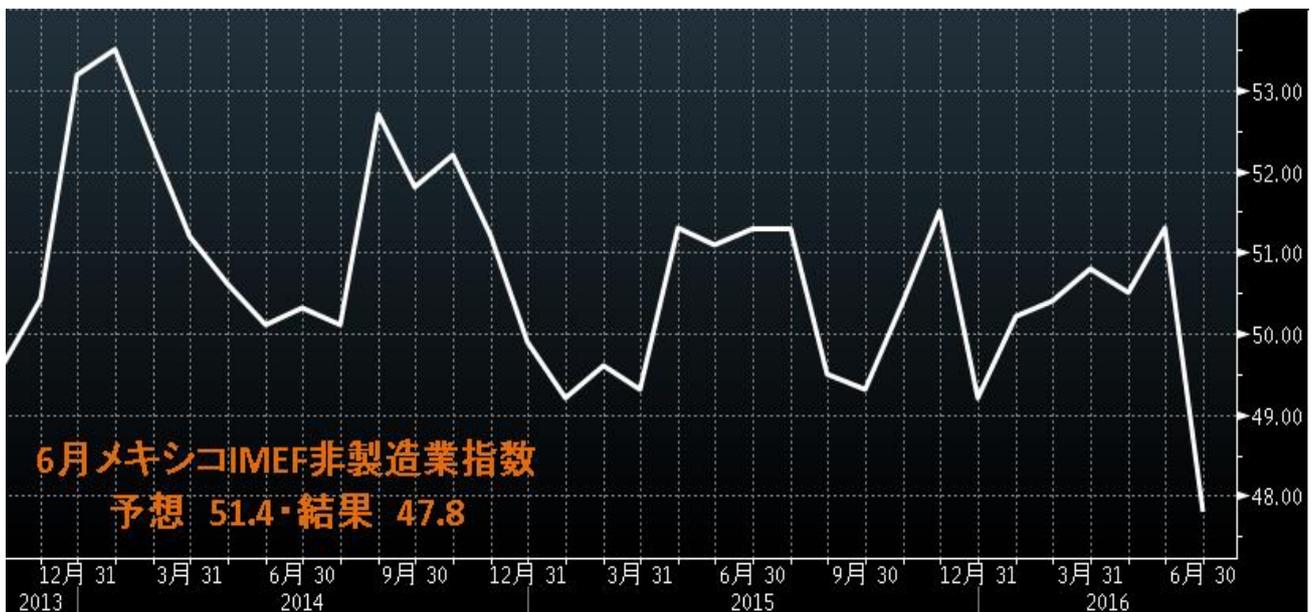
◀ 経済指標の結果 ▶

6月メキシコ IMEF 製造業指数 47.5 (予想 52.1・前回 51.4)
前回発表の 51.9 から 51.4 に修正

6月メキシコ IMEF 非製造業指数 47.8 (予想 51.4・前回 50.8)
前回発表の 51.3 から 50.8 に修正



出所：Bloomberg



出所：Bloomberg

◀ NY 外国為替市場 序盤 ▶

序盤の外国為替市場は、4日の独立記念日を含む3連休を控え、積極的な売買が控えられている。また、週明けから円安が進行したことで、ポジション調整から円を買い戻す動きも出た。

22:33

米主要株価

米主要株	株価	前日比
ダウ平均	17925.02	-4.97
ナスダック	4839.23	-3.44

出所：SBILM

22 : 45

◀ 経済指標の結果 ▶

6月マークイット米国製造業 PMI 51.3 (予想 51.2・前回 51.4)



出所 : Bloomberg

23 : 00

◀ 経済指標の結果 ▶

6月米ISM製造業景況指数 53.2 (予想 51.3・前回 51.3)



出所 : Bloomberg

経済指標データ

◀ 米 ISM 製造業景況指数 ▶

	6月	5月	4月	3月	2月	1月
景気	53.2	51.3	50.8	51.8	49.5	48.2
価格	60.5	63.5	59.0	51.5	38.5	33.5
生産	54.7	52.6	54.2	55.3	52.8	50.2
新規受注	57.0	55.7	55.8	58.3	51.5	51.5
受注残	52.5	47.0	50.5	51.0	48.5	43.0
入荷遅延	55.4	54.1	49.1	50.2	49.7	50.0
在庫	48.6	45.0	45.5	47.0	45.0	43.5
雇用	50.4	49.2	49.2	48.1	48.5	45.9

23:00

◀ 経済指標の結果 ▶

5月米建設支出(前月比) -0.8% (予想 0.6%・前回 -2.0%)
 前回発表の-1.8%から-2.0%に修正



出所: Bloomberg

23:15

◀ 要人発言 ▶

フィッシャーFRB 副議長

- ・「英離脱による米国への影響、これから見極める必要」
- ・「米経済はかなり好調」
- ・「FOMCは英離脱の影響に照らし米データをみる必要」
- ・「FOMCは会合ごとに政策を決定する」

- ・「5月の雇用統計は懸念要因となった」
- ・「ドルは年初に比べて弱くなった」
- ・「ドルの予想は難しい、FOMCはそれを考慮」
- ・「国外で起きていることは考慮される」

- ・「マイナス領域に踏み込む計画はない」
- ・「量的緩和、ガイダンスは手段だが使わないことを望む」
- ・「金融政策では生産性を直接押し上げられない」
- ・「米選挙は不透明感を生じさせている」

23 : 35

◀ NY 株式市場 序盤 ▶

序盤の株式市場は、日欧や英国で緩和的な金融政策が長引くことが改めて意識され、主要株価は堅調な動きとなった。ただし、米金融市場の3連休入りを前に様子見ムードも強く、やや上値は限定的となった。

◀ 経済指標のポイント ▶

- (1) 6月米ISM製造業景況指数は、市場予想の51.3を上回る53.2となり、2015年2月以来1年4ヵ月ぶりの高水準となった。また、景気判断の基準となる50を4ヵ月連続で上回った。関連指数では、生産が54.7(前月52.6)、新規受注が57.0(55.7)、受注残が52.5(47.0)、入荷遅延が55.4(54.1)、在庫が48.6(45.0)、雇用が50.4(49.2)と前月を上回る結果となったが、価格は60.5(63.5)と前月から低下した。6月は18業種中「石油・石炭製品」「食品・飲料・たばこ製品」など13業種が景況拡大を報告した。
- (2) 5月の米建設支出は、年率換算で前月比-0.8%の1兆1432億5700万ドルとなり、2ヵ月連続のマイナスとなった。金額ベースでは、2015年12月以来の低水準、前年同月比では+2.8%となった。
- ① 民間の建設支出は、-0.3%の8593億600万ドル、前年同月比では+4.7%。住宅建設は、前月比0.0%の4518億8000万ドルとなり、一戸建て住宅が不振だった。住宅以外の建設は、前月比-0.7%の4074億2700万ドル。オフィスや商業、教育、宗教、製造業など幅広い分野で減少した。一方、宿泊、通信、輸送は増えた。
- ② 連邦政府など公共部門の建設支出は、前月比-2.3%の2839億5100万ドルとなり、3ヵ月連続のマイナス。前年同月比では-2.6%。州・地方政府が前月比-3.0%と大きく減少し、2014年11月以来の大きな減少率となった。一方、連邦政府は+7.5%となった。

0 : 15

◀ 要人発言 ▶

メスター・クリーブランド連銀総裁

- ・「英離脱は、ドルへの長期打撃で米国に波及も」
- ・「英投票後に米見通しへのリスクと不透明感が上昇」
- ・「米労働市場に著しい反転が起きるとみていない」
- ・「利上げ先送りの長期化は金融の安定を脅かす可能性」
- ・「英離脱、米国への影響判断は時期尚早」

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6577.83	+73.50
仏 CAC40	4273.96	+36.48
独 DAX	9776.12	+96.03
ストック欧州 600 指数	332.24	+2.36
ユーロファースト 300 指数	1313.45	+10.18
スペイン IBEX35 指数	8268.90	+105.60
イタリア FTSE MIB 指数	16295.78	+98.00
南ア アフリカ全株指数	52357.50	+139.78

出所：SBILM

＜欧州株式市場＞

欧州株式市場は、世界の金融政策当局が英国の EU 離脱問題を受け金融緩和策を講じるとの思惑を背景に、主要株価は 4 営業日続伸となった。英 FT100 は、約 10 ヶ月半ぶり高値で引けた。



出所：Bloomberg

1:00

米主要株価・中盤

ダウ 17981.32 (+51.33)、S&P500 2103.36 (+4.50) ナスダック 4869.89 (+27.21)

＜欧州のポイント＞

- ①米格付け会社 S&P は、EU の長期信用格付けを、上から 2 番目の「AA+」から「AA」に 1 段引き下げた。大手格付け会社が EU を格下げするのは、英国が国民投票で EU 離脱を決めてから初めて。格下げの理由について、「EU への拠出金の大きかった英国の離脱意思は、EU 財政の柔軟性を損ねるとともに、加盟国の結束力を弱めるだろう」と指摘。今後の財政見通しなどは不確実性を増したとしている。格付けの今後の見通しは「安定的」とした。
- ②クーレ ECB 専務理事は、主要中央銀行が英国の EU 離脱決定による市場への影響を監視しており、金融の安定が脅かされた場合には介入する用意が整っていると指摘した。専務理事は、英国の離脱に向けた行程表を明確にすることが急務だと指摘。不透明な状況が長引けば経済的損失が英国だけでなく EU にも生じると述べた。また、通貨ユーロは保護されるべきだとの見解を示すとともに、金融・財政面でより統合された状況に向かう必要があると指摘した。
- ③EU 統計局は、ユーロ圏 19 カ国の 5 月の失業率が 10.1%となり、前月より 0.1 ポイント改善したと発表し、2011 年 7 月以来、4 年 10 ヶ月ぶりの低水準となった。主要国はドイツが 4.2% (前月 4.3%)、フランスは 9.9% (9.9%)、イタリアは 11.5% (11.6%)、またスペインは 19.8% (20.1%) となり、20%を下回るのは 2010 年 5 月以来 6 年ぶり。圏内最悪のギリシャは 3 月時点で 24.1%、EU 域内最低はチェコの 4.0%。EU28 カ国の 5 月の失業率は 8.6% (前月 8.7%)。
- ④オーストリア大統領選の決選投票で不正があったとして、移民規制派の右派、自由党が選挙無効を求めた訴訟 (郵送票が一部で決められた時間より早く開票するなど郵送票の開票方法に問題があったとされる) で、オーストリアの憲法裁判所は、大統領選挙の決選投票をやり直す必要があるとの判断を示した。新大統領は予定していた 8 日に就任できず空席となり、国民議会の第 1~第 3 議長が共同で大統領職を代行する異例の事態となる。オーストリアでは移民の大量流入による負担増に国民が反発しており、決選投票で敗れた自由党のホーファー国民議会第 3 議長がやり直し選挙で勝利する可能性が高い。ホーファー氏は、EU が改革を実施しなければ、離脱を問う国民投票を実施すると主張しており、EU 離脱の動きが拡大する恐れがある。

◀ 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 離脱問題への懸念から安全資産とされる米国債への資金流入が続いた。米長期金利の指標となる 10 年債利回りは未明の取引で一時 1.38% 台を付け、過去最低水準となった。ただ、その後は米 ISM 製造業景況指数が市場予想を上回ったことをきっかけに売りも出てもみ合いの展開が続いた。

午前の利回りは、30 年債が 2.26% (前日 2.29%)、10 年債が 1.46% (1.47%)、7 年債が 1.28% (1.28%)、5 年債が 1.00% (1.00%)、3 年債が 0.70% (0.70%)、2 年債が 0.59% (0.58%)。

6 月米自動車販売

フィアット・クライスラーは+6.5% (予想+8.9%) フォードは+6.4% (予想+4.9%) GMは-1.6% (予想-0.7%) VWは-22.0%。トヨタは-5.6% (予想+3.6%) 日産は+13.1% (予想+7.2%) ホンダは+3.2% (予想+9.4%)

3 : 40

NY 金は、中心限月が前日比 18.40 ドル高の 1 オンス=1339.00 ドルで取引を終了した。

4 : 30

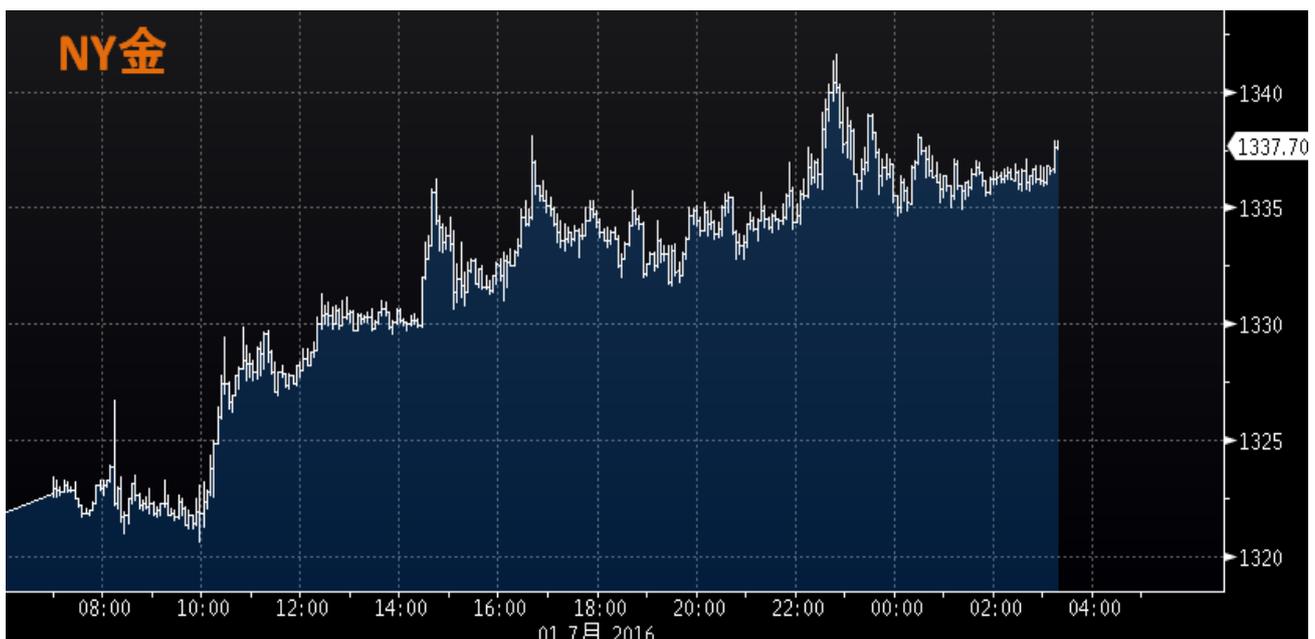
NY 原油は、中心限月が前日比 0.66 ドル高の 1 バレル=48.99 ドルで取引を終了した。

主要商品	終 値	前日比
NY GOLD	1339.00	+18.40
NY 原油	48.99	+0.66

出所：SBILM

◀ NY 金市場 ▶

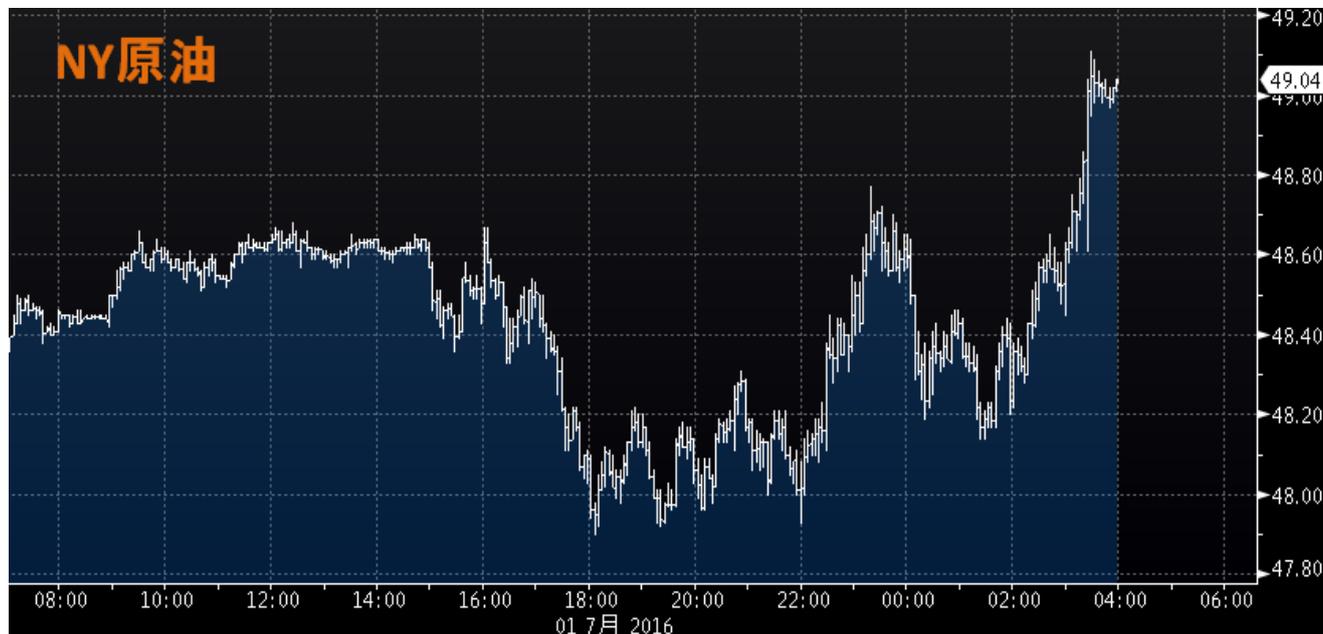
NY 金は、英国の EU 離脱決定で世界経済の先行き不透明感が強まっていることが、引き続き金の逃避買いを促した。また、世界的に緩和的な金融政策が続き、金に資金が流入すると期待も支援材料となった。終値ベースでは、2014 年 7 月以来、約 2 年ぶりの高値水準となった。



出所：Bloomberg

◀ NY 原油市場 ▶

NY 原油は、ドルが主要通貨に対して下落し、ドル建ての原油先物に割安感が出たことから買いが優勢となった。米製造業関連の経済指標が市場予想を上回ったことも好感された。ただ、米石油サービス大手が発表した米国の石油掘削装置の稼働数が増えたことで供給増加が意識され、上げ幅が縮小する場面もあった。



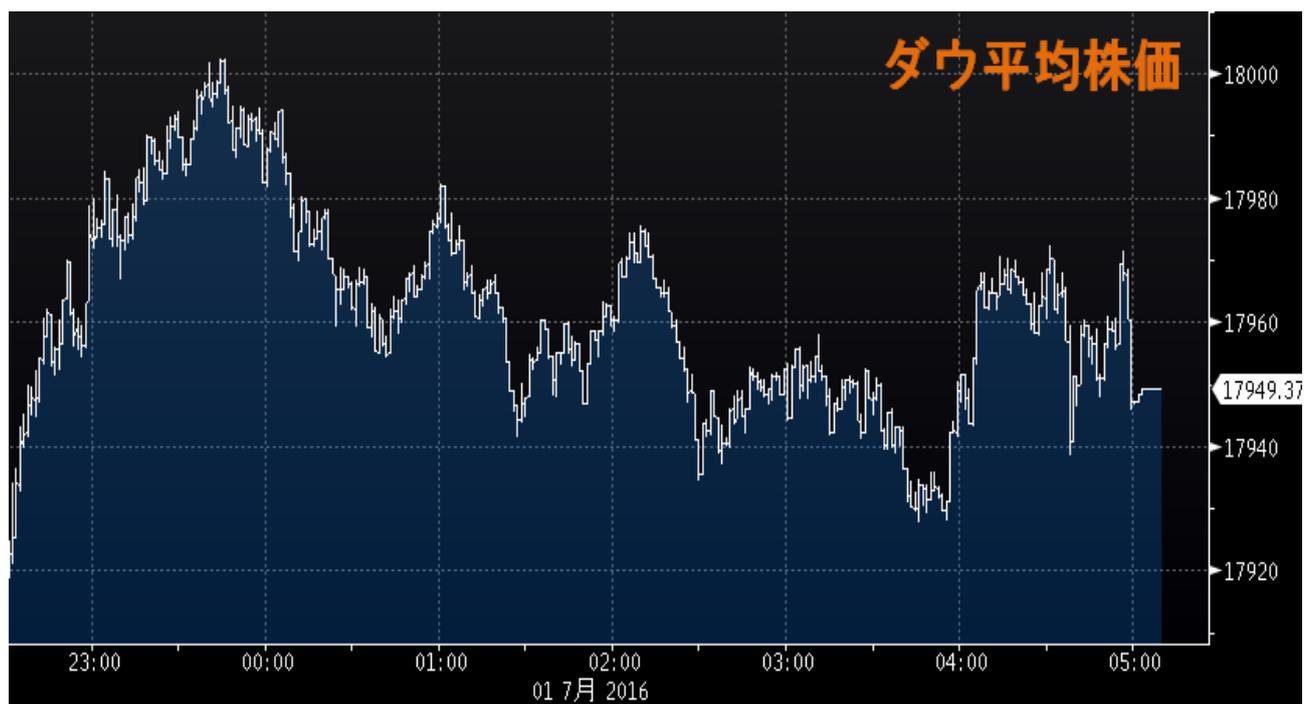
出所：Bloomberg

主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	17949.37	+19.38	18002.38	17916.91
S&P500 種	2102.95	+4.09	2108.71	2097.90
ナスダック	4862.57	+19.89	4880.17	4837.17

出所：SBILM

◀ 米株式市場 ▶

米株式市場は、日欧や英国で緩和的な金融政策が長引くことがあらためて意識され、序盤の主要株価は堅調な動きとなった。ただ、米金融市場の3連休入りを前に様子見ムードも強く、調整の動きが出るなど、上値の重い動きとなった。ダウ平均株価が、序盤 18000 ドル台まで上昇したものの、その後はマイナス圏まで下落するなど、上値の重い動きとなった。



出所：Bloomberg

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	102.58	102.74	102.46
EUR/JPY	114.19	114.58	113.99
GBP/JPY	136.15	136.86	135.77
AUD/JPY	76.86	76.96	76.67
NZD/JPY	73.48	73.83	73.38
EUR/USD	1.1133	1.1170	1.1113
AUD/USD	0.7493	0.7504	0.7474

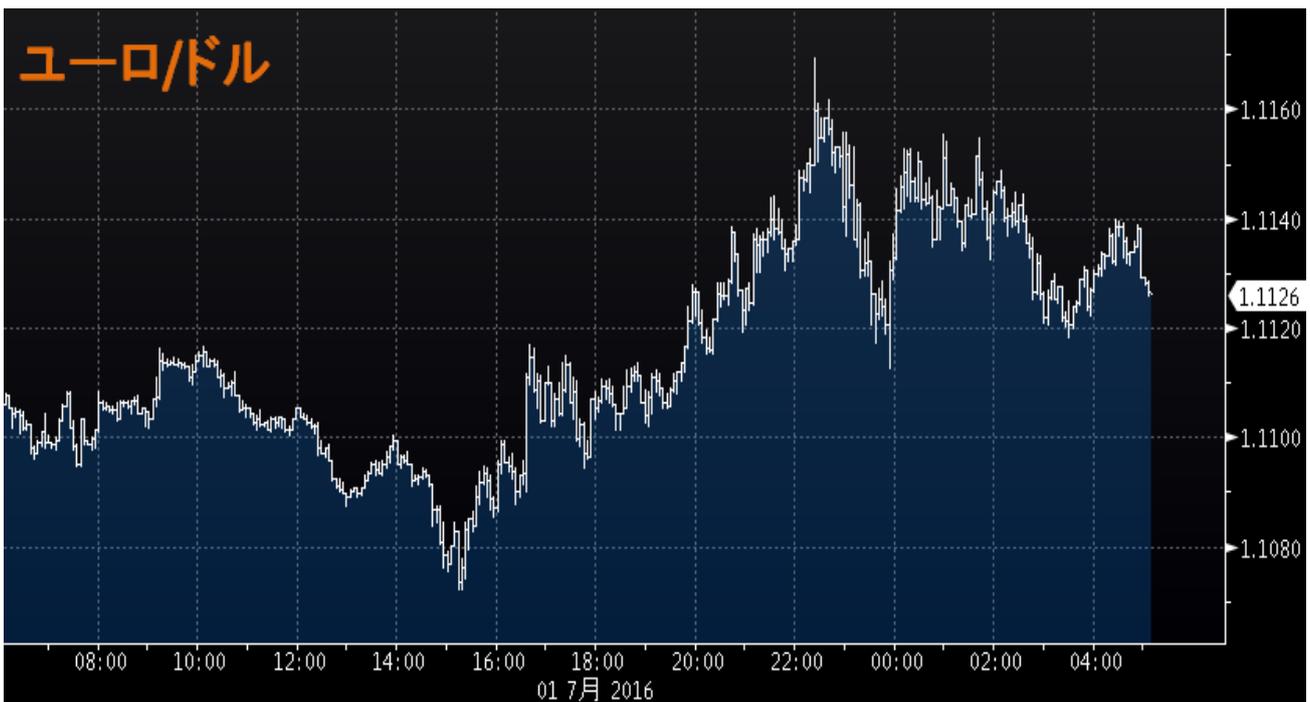
出所：SBILM

◀外国為替市場▶

外国為替市場は、序盤は欧米の株価が上昇したことを受けて、ドル円・クロス円も上昇したものの、午後には株価が軟調な動きとなり、一時マイナス圏まで下落したことから、終盤まで上値の重い動きが続いた。ただ、米国の3連休を控えて積極的な売買が手控えられたこともあり、限定的な動きとなった。



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。