

NYマーケットレポート (2019年7月1日)

2019年7月1日(月)

| アジア主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|-----------|----------|---------|---------|
| 日経平均 | 21729.97 | +454.05 | 8.57% |
| ハンセン指数 | 休場 | | #VALUE! |
| 上海総合 | 3044.90 | +66.02 | 22.09% |
| 韓国総合 | 2129.74 | -0.88 | 4.35% |
| 豪ASX200 | 6648.10 | +29.33 | 17.74% |
| シンガポールST | 3372.26 | +50.65 | 9.89% |
| インドSENSEX | 39686.50 | +291.86 | 10.03% |

*香港市場は香港特別行政区設立記念日のため休場

| 外国為替 | 終値 | 高値 | 安値 |
|---------|--------|--------|--------|
| USD/JPY | 108.44 | 108.53 | 108.11 |
| EUR/JPY | 122.38 | 123.36 | 122.36 |
| GBP/JPY | 137.04 | 137.79 | 136.74 |
| AUD/JPY | 75.52 | 76.28 | 75.43 |
| EUR/USD | 1.1285 | 1.1371 | 1.1281 |
| BRL/JPY | 28.416 | 28.417 | 28.400 |
| RUB/JPY | 1.736 | 1.738 | 1.736 |

| 欧州主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|----------------|----------|----------|--------|
| 英FT100 | 7497.50 | +71.87 | 11.44% |
| 仏CAC40 | 5567.91 | +28.94 | 17.70% |
| 独DAX | 12521.38 | +122.58 | 18.59% |
| スペインIBX35 | 9264.60 | +65.80 | 8.49% |
| イタリアFTSE MIB | 21254.04 | +19.25 | 15.99% |
| トルコ・イスタンブール100 | 99735.68 | +3250.36 | 9.27% |
| ロシアRTS | 1401.64 | +21.12 | 31.15% |
| 南ア全株指数 | 58472.52 | +268.68 | 10.88% |

| コモディティ | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|---------|---------|--------|---------|
| NY GOLD | 1389.30 | -24.40 | 8.43% |
| NY 原油 | 59.09 | +0.62 | 30.13% |
| CBOTコーン | 422.50 | -9.00 | 12.67% |
| CRB指数 | 181.135 | +0.098 | 6.67% |
| ドル指数先物 | 96.844 | +0.714 | 0.70% |
| VIX指数 | 14.06 | -1.02 | -44.69% |

| 米国主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|--------|----------|---------|--------|
| 米ダウ平均 | 26717.43 | +117.47 | 14.53% |
| S&P500 | 2964.33 | +22.57 | 18.25% |
| NASDAQ | 8091.16 | +84.92 | 21.94% |

| 南北米主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|-------------|-----------|---------|---------|
| カナダ・トロント総合 | 休場 | | #VALUE! |
| メキシコ・ボルサ指数 | 43438.24 | +277.07 | 4.32% |
| ブラジル・ボベスパ指数 | 101339.68 | +372.48 | 15.31% |

x一部暫定値

| Crypto Currency | 本日 | 前日 |
|--------------------|--------|--------|
| CME Bitcoin(先物・期近) | 10675 | 12510 |
| Ripple (BSTP) | 0.398 | 0.416 |
| Ethereum (BSTP) | 288.75 | 307.05 |
| Bitcoin Cash | 408.08 | 429.74 |

| 日本国債利回り | 本日 | 前日 |
|---------|---------|---------|
| 2年債 | -0.217% | -0.217% |
| 5年債 | -0.243% | -0.256% |
| 10年債 | -0.146% | -0.158% |
| 30年債 | 0.382% | 0.362% |

| 欧州国債利回り | 本日 | 前日 |
|-----------|---------|---------|
| ドイツ10年債 | -0.357% | -0.328% |
| 英国 10年債 | 0.814% | 0.838% |
| フランス 10年債 | -0.050% | -0.008% |

| 米国債利回り | 本日 | 前日 |
|--------|--------|--------|
| 2年債 | 1.787% | 1.757% |
| 3年債 | 1.739% | 1.712% |
| 5年債 | 1.789% | 1.768% |
| 7年債 | 1.897% | 1.877% |
| 10年債 | 2.024% | 2.007% |
| 30年債 | 2.548% | 2.533% |

7/2 経済指標スケジュール

| | |
|-------|----------------------|
| 08:50 | 【日本】6月マネタリーベース |
| 13:30 | 【オーストラリア】政策金利発表 |
| 15:00 | 【英国】6月ネーションワイド住宅価格 |
| 15:00 | 【ドイツ】5月小売売上高指数 |
| 15:45 | 【フランス】5月財政収支 |
| 17:30 | 【英国】6月建設業PMI |
| 17:30 | 【香港】5月小売売上高 |
| 18:00 | 【欧州】5月生産者物価指数 |
| 20:00 | 【メキシコ】5月景気先行指数 |
| 23:00 | 【米国】7月IBD/TIPP景気楽観指数 |
| 02:00 | 【ニュージーランド】6月QV住宅価格 |

7/2 主要会議・講演・その他予定

- ・ロウRBA総裁の発言
- ・ニューヨーク連銀総裁 講演
- ・クレーブランド連銀総裁 講演
- ・欧州議会本会議 (~4日)

NY 市場レポート

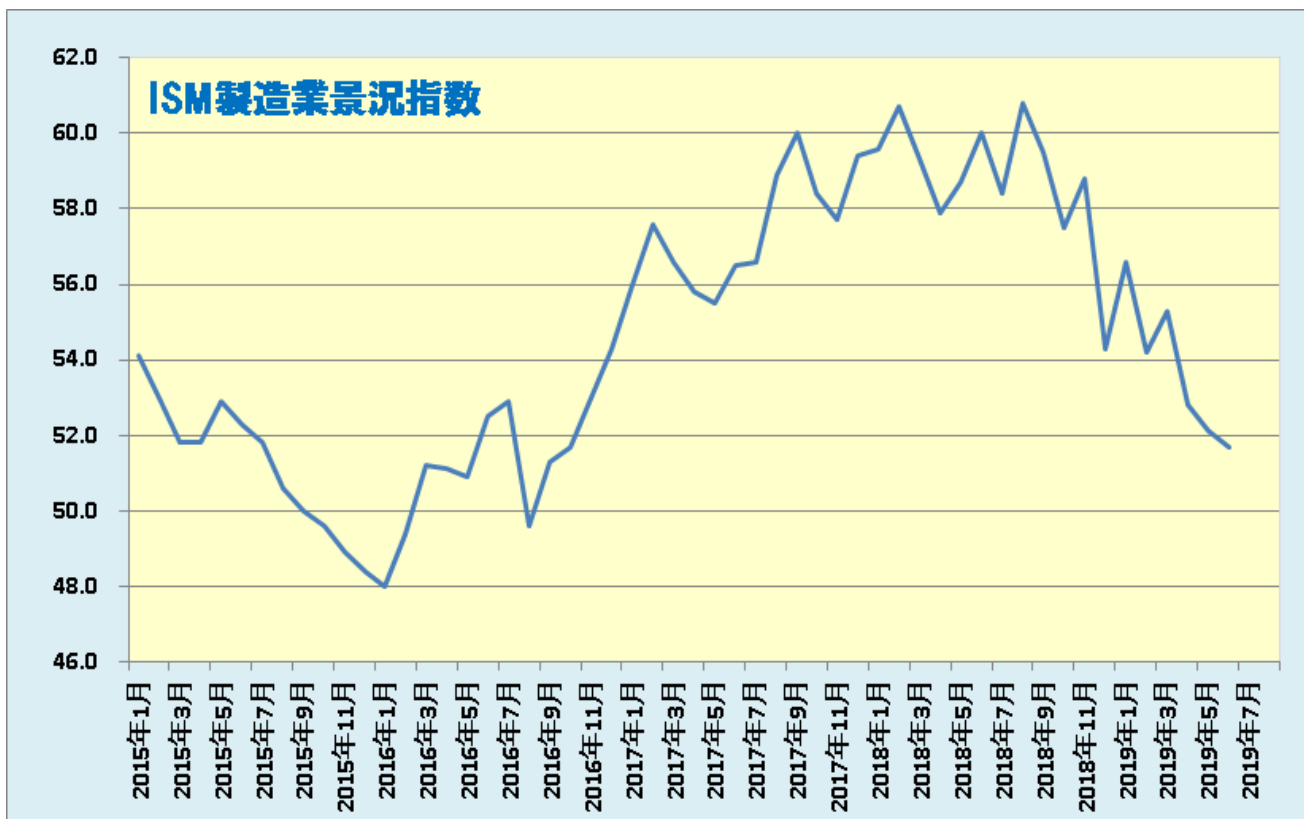
◀ NY 市場概況 ▶

序盤に発表された米 ISM 製造業景況指数、建設支出がともに低調な内容だったことが影響し、序盤のドルは上値の重い動きとなった。しかし、米国と中国が通商協議再開で合意したことが好感され、米主要株価が軒並み上昇したことからドルは底固い動きとなり、さらに米国債利回りが上昇したこともドルの下支え要因となった。

主要な米経済指標結果

6 月 ISM 製造業景況指数 51.7 (予想 51.0・前回 52.1)

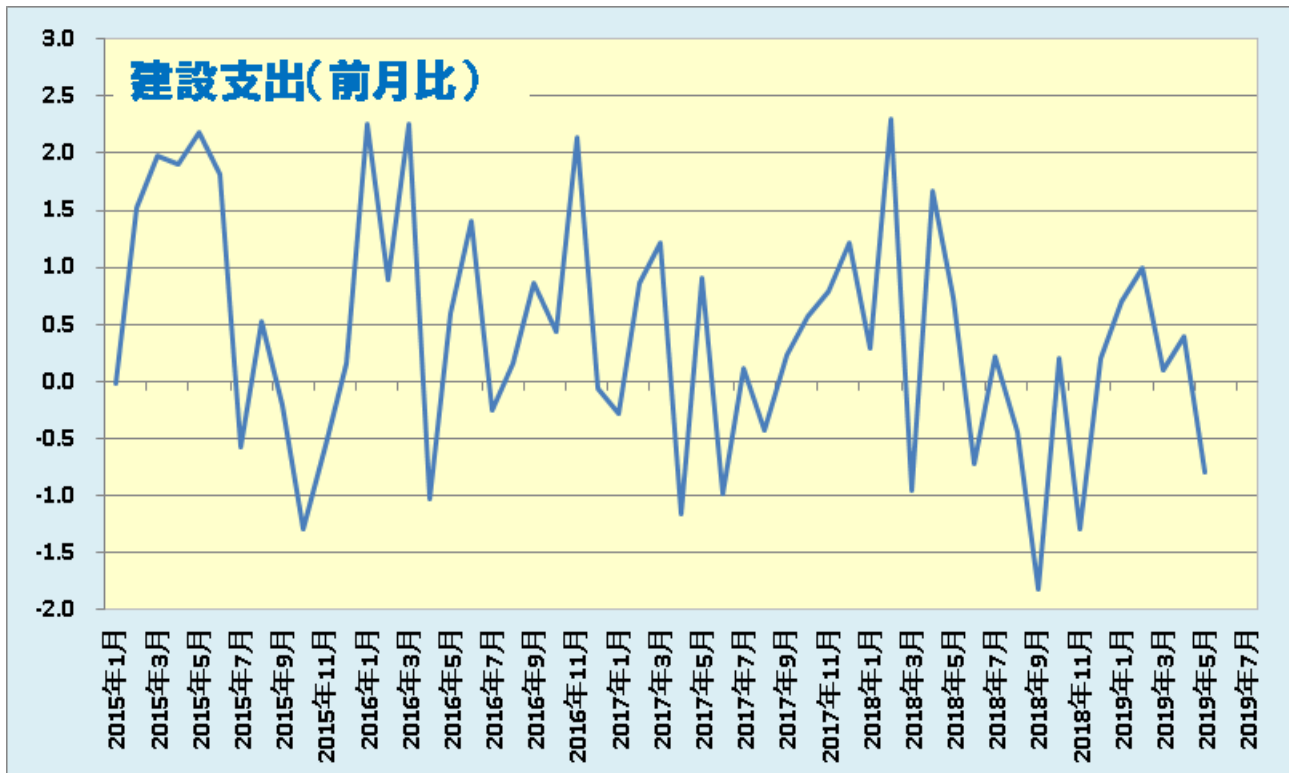
6 月の米 ISM 製造業景況指数は、市場予想ほど低下しなかったものの、前月から 0.4 ポイント低下となり、2016 年 10 月以来、2 年 8 ヶ月ぶりの低水準となった。ただ、景気拡大・縮小の判断基準となる 50 は 34 ヶ月連続で上回った。新規受注が 50.0 (前月 52.7)、仕入れ価格が 47.9 (53.2)、在庫が 49.1 (50.9) と前月から低下した一方、生産は 54.1 (51.3)、雇用は 54.5 (53.7) と上昇した。18 業種中 12 業種が景況拡大を報告、3 業種が業況の縮小を報告した。



データを基に SBILM が作成

5月建設支出（前月比） -0.8%（予想 0.0%・前回 0.0%⇒0.4%）

5月の米建設支出は、市場予想を下回り、2018年11月以来のマイナスとなった。民間の建設支出は、前月比-0.7%となり、住宅建設が-0.6%、住宅以外は-0.9%となり、オフィスや商用施設の減少が目立った。一方、公共部門の建設支出は、前月比-0.9%だった。



データを基に SBILM が作成

ナスダックは4営業日続伸、S&P500は過去最高値を更新

米株式市場は、米中首脳会談で通商協議の再開で合意したことや、中国からの輸入品に対する追加制裁関税を見送ったことを受けて、米主要株価は序盤から堅調な動きとなった。また、ファーウェイ制裁の一部解除が明らかとなったことが好感され、ハイテク株が買われた。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前日比 290 ドル高まで上昇した。その後は、上げ幅を縮小し、117 ドル高で終了した。一方、ハイテク株中心のナスダックは 84 ポイント高で終了し、4 営業日続伸した。また、S&P500 は過去最高値を更新した。



データを基に SBILM が作成

| セクター別変動率(ダウ平均) | | | 個別の変動率(ダウ平均銘柄) | | |
|----------------|---------|-------|----------------|-------------|-------|
| | セクター | 変動率 | | 銘柄 | 変動率 |
| 1 | 素材金融 | 1.72% | 1 | アップル | 1.83% |
| 2 | テクノロジー | 1.31% | 2 | ナイキ | 1.74% |
| 3 | 消費財 | 1.22% | 3 | DOW | 1.72% |
| 4 | 金融 | 1.04% | 4 | JPモルガン・チェース | 1.68% |
| 5 | 消費者サービス | 0.43% | 5 | ウォルトディズニー | 1.44% |

データを基に SBILM が作成

ドル円は底固い動き

序盤に発表された米 ISM 製造業景況指数は、2016 年 10 月以来 2 年 8 ヶ月ぶりの低水準、建設支出は 2018 年 11 月以来のマイナスとなるなど、ともに低調な結果だったことが影響し、ドルは序盤上値の重い動きとなった。しかし、米国と中国が通商協議再開で合意したことで、通商問題に対する楽観的な見通しが強まったことを背景に、米主要株価が軒並み上昇となり、ドルは底固い動きとなった。さらに、米 10 年債利回りが 2.0016%から 2.0464%まで上昇したこともドルの下支え要因となった。一方、ECB の金融緩和に対する懸念を背景に、欧州主要国の国債利回りが低下し、これに対して米国債利回りが上昇したことで、ユーロ売り・ドル買いとなり、ユーロはドルや円に対して下落した。さらに、イタリアの 2019 年の財政赤字目標が対 GDP 比で 2.4%から 2.04%に引き下げと報じられたことも圧迫要因となった。



出所：総合分析チャート

前営業日のロシアルーブル、ブラジルリアル

◇ロシアルーブル

週明け 1 日のルーブルは 62.85 ルーブル、対円では 1.7230 円と対ドルで上昇した一方、対円で下落。先週末 29 日の米中首脳会談での追加制裁関税の先送りや通商交渉再開を好感したリスク選好の動きを背景にロシア

株式市場の上昇とともにドルでルーブル買いも観測されたほか、OPEC 総会での減産延長を背景に原油価格が上昇したことも支援要因となった。

ドル建のロシア RTS 株価指数は 21.12Pts 高の 1401.64Pts また、MOEX 指数は史上最高値を更新する 2801.47Pts (35.62Pts 高) で取引を終えた。米中首脳会談を終えてのリスク選好の動きや OPEC 総会での協調減産延長などが好感された格好。

◇ブラジルリアル

週明け 1 日のリアルは 1 ドル=3.8426 レアル、対円で 28.209 円と対ドルで続落した一方、対円で反発した。米中首脳会談での追加制裁関税先送りや通商交渉再開を好感したリスク先行を背景にした資本流入期待が好感された一方、年金改革を巡る先行き不透明感やブラジル中銀の利下げ観測もリアル上昇の足かせとなった。

ボブスパ指数は 372.48ts 高の 101,339.68Pts と 4 日続伸して取引を終了した。年金改革法案を巡る不透明感が上値抑制となったものの、中国での豚コレラの影響で需要期待や価格上昇への期待も好材料となった。

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。