

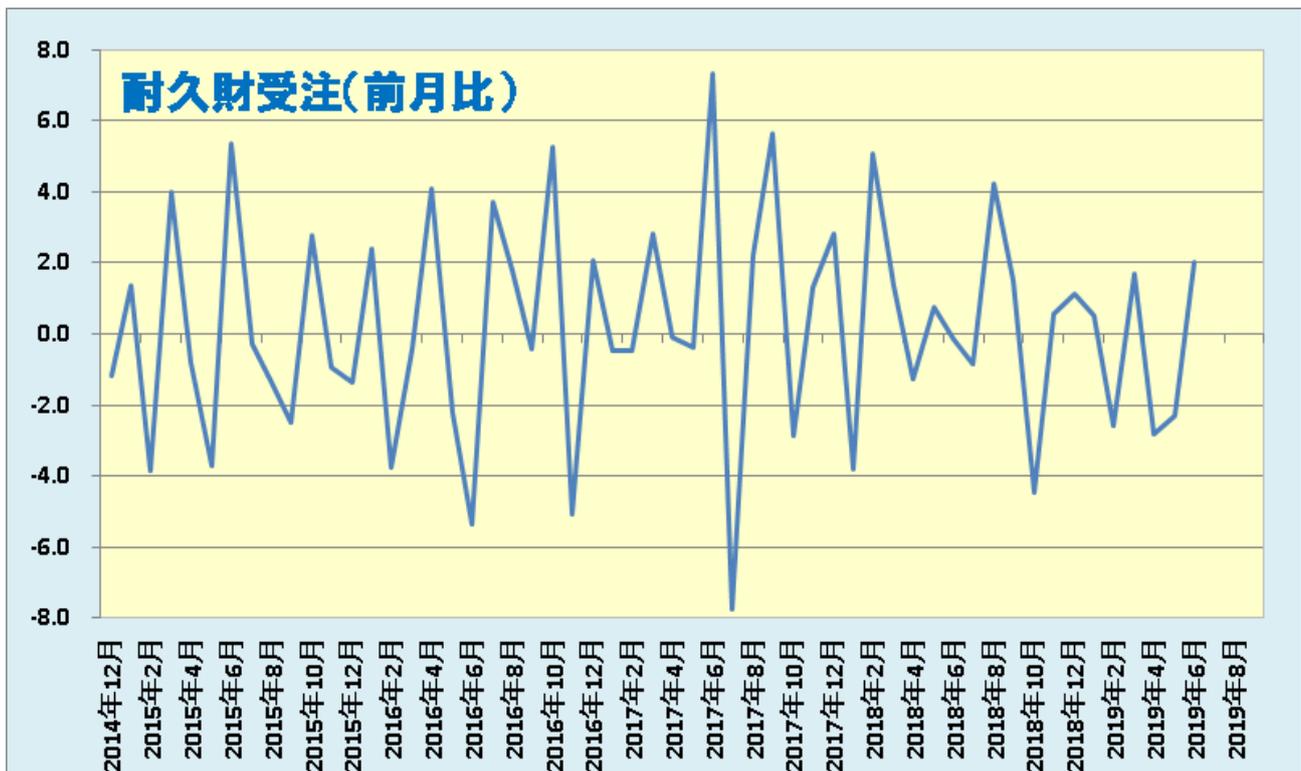
NY 市場レポート

主要な米経済指標結果

6月耐久財受注（前月比） 2.0%（予想 0.8%・前回 -1.3%⇒-2.3%）

6月耐久財受注[除輸送用機器]（前月比） 1.2%（予想 0.2%・前回 0.4%⇒0.5%）

6月の耐久財受注は、市場予想を上回り、上昇率は2018年8月以来の大きさとなった。また、輸送機器を除いた受注も+1.2%と市場予想を上回った。統計データを見ると、輸送機器は+3.8%と（前月-7.5%）なり、民間航空機が+75.5%（-52.2%）、自動車・同部品は+3.1%（+0.9%）だった。輸送機器以外では、コンピューターが+0.4%（+0.7%）、一次金属が+0.8%（-0.7%）、電子機器が+0.1%（+1.3%）、機械が+2.4%（+0.2%）だった。また、資本財は+1.4%（-6.5%）となり、資本財から国防関連を除いた受注は+4.8%（-4.9%）、コア受注は+1.9%（+0.3%）だった。国防関連は-16.3%（-14.1%）だった。



データを基に SBILM が作成

新規失業保険申請件数 20.6 万件（予想 21.8 万件・前回 21.6 万件）

失業保険継続受給者数 167.6 万人（予想 168.8 万人・前回 168.6 万人⇒168.9 万人）

米失業保険申請件数は、前週比-1.0 万件と市場予想を下回る改善となり、4 月以来 3 ヶ月ぶりの低水準となった。申請件数の 4 週移動平均は、前週比-5750 件の 21.3 万件。また、集計が 1 週遅れる失業保険継続受給者数は、前週比-1.3 万人となり、受給者数の 4 週移動平均は前週比-4500 人の 169.7 万人となった。



データを基に SBILM が作成

ダウ平均は続落、ナスダック 4 営業日ぶりの反落

米株式市場は、前日引け後に発表された自動車大手の四半期決算が冴えない結果となったことから、米企業業績への懸念が広がり、主要株価指数は序盤から軟調な動きとなった。さらに、ドラギ ECB 総裁の会見を受けて、大幅かつ早期の金融緩和策に慎重との思惑が広がったほか、好調な米経済指標を受けて長期金利が上昇、FRB の大幅利下げ観測の後退も圧迫要因となった。ダウ平均株価は序盤から軟調な動きとなり、一時前日比 207 ドル安まで下落後、下げ幅を縮小し 128 ドル安で終了した。一方、ハイテク株中心のナスダックは 82 ポイント安で終了し、4 営業日ぶりの反落となった。



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	-2.02%	1	DOW	-3.83%
2	資本財	-0.71%	2	ボーイング	-3.69%
3	金融	-0.67%	3	インテル	-1.44%
4	石油・ガス	0.83%	4	コカ・コーラ	-1.32%
5	テクノロジー	0.88%	5	シスコシステムズ	-1.07%

データを基に SBILM が作成

ドル/円は 7/10 以来の高値、ユーロ/円は 1/3 以来の安値を更新

NY 市場では、序盤に発表された 6 月の耐久財受注が予想を上回り、2018 年 8 月以来の大きな伸びとなったほか、新規失業保険申請件数が 3 ヶ月ぶりの低水準に改善したことを受けて米 10 年債利回りが 2.0097% から 2.0985% まで上昇したことを背景にドル買いが優勢となる中、ドル/円は 108.50 まで上昇した。その後、ドラギ ECB 総裁が、早急な緩和策導入を示唆しなかったものの、大規模な追加金融緩和がなお必要だとの見方を示したことで、対ドルで 1.1102 から 1.1188 へ反発したユーロが再度反落。さらに好調な米経済指標を受けて FRB の大幅利下げ観測の後退も、ドル買いを強める中、ドル/円も 7/10 以来となる 108.75 まで上昇した。



出所：総合分析チャート

前営業日のロシアルーブル、ブラジルレアル

◇ロシアルーブル

昨夜 25 日のルーブルは対ドルで 63.00875 ルーブルと対ドルで反落した一方、対円では 1.7204 円とルーブル高となった。今晚の 26 日のロシア中銀政策委員会での利下げ観測がルーブルの重石となった。一方、ドル

建のロシア RTS 株価指数は 7.29Pts 高の 1,346.91Pts と反発したほか、MOEX 指数も 2,701.02Pts (18.11 Pts 高) と反発した。ECB 理事会を前にした緩和期待に加え、原油価格の上昇も株式市場上昇を支援した。

◇ブラジルリアル

リアルは対ドルで 3.7819 レアルと反落した一方、対円で 28.739 円と反発した。ECB 理事会を受けて早期の利下げ観測が後退、さらに好調な米経済指標を背景に FRB の大幅利下げ観測の後退も影響し、ボブスバ指数の下落も対ドルでの反落につながった。

一方、ボブスバ指数は 1,464.96Pts 安の 102,654.58Pts と 7/3 以来の水準へ反落した。ECB 理事会で、一部に観測されていた利下げが見送られたほか、債券買入れへの具体的な言及も聞かれなかったほか、FRB の大幅利下げ観測も後退したことが影響した。

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。