

NY マーケットレポート (2019年8月2日)

2019年8月2日 (金)

アジア主要株価	終値	前日比	年初来%
日経平均	21087.16	-453.83	5.36%
ハンセン指数	26918.58	-647.12	4.15%
上海総合	2867.84	-40.93	14.99%
韓国総合	1998.13	-19.21	-2.10%
豪ASX200	6768.57	-20.35	19.87%
シンガポールST	3261.11	-30.64	6.27%
インドSENSEX	37118.22	+99.90	2.91%

外国為替	終値	高値	安値
USD/JPY	106.58	107.57	106.51
EUR/JPY	118.37	119.13	118.27
GBP/JPY	129.59	130.42	129.08
AUD/JPY	72.45	73.16	72.22
EUR/USD	1.1106	1.1116	1.1070
BRL/JPY	27.434	28.013	27.388
RUB/JPY	1.634	1.671	1.628

欧州主要株価	終値	前日比	年初来%
英FT100	7407.06	-177.81	10.09%
仏CAC40	5359.00	-198.41	13.28%
独DAX	11872.44	-380.71	12.44%
スペインIBX35	8897.60	-140.60	4.19%
イタリアFTSE MIB	21046.86	-520.05	14.86%
トルコ・イスタンブール100	99679.44	-2220.81	9.21%
ロシアRTS	1293.19	-53.21	21.00%
南ア全株指数	56273.92	-949.69	6.71%

コモディティ	終値	前日比	年初来%
NY GOLD	1457.50	+25.10	13.75%
NY 原油	55.66	+1.71	22.57%
CBOTコーン	399.50	+6.50	6.53%
CRB指数	173.350	+0.55	2.09%
ドル指数先物	98.100	-0.27	2.00%
VIX指数	17.61	-0.26	-30.72%

米国主要株価	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	26485.01	-98.41	13.54%
S&P500	2932.05	-21.51	16.96%
NASDAQ	8004.07	-107.05	20.63%

南北米主要株価	終値	前日比	年初来%
カナダ・トロント総合	16271.66	-105.38	13.61%
メキシコ・ボルサ指数	39977.52	-369.28	-3.99%
ブラジル・ボベスパ指数	102673.68	+547.74	16.82%

Crypto Currency	本日	前日
CME Bitcoin(先物・期近)	10535	10580
Ripple (BSTP)	0.310	0.316
Ethereum (BSTP)	215.27	217.64
Bitcoin Cash	322.60	328.56

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.201%	-0.183%
5年債	-0.249%	-0.218%
10年債	-0.163%	-0.130%
30年債	0.328%	0.372%

欧州国債利回り	本日	前日
ドイツ10年債	-0.488%	-0.450%
英国10年債	0.554%	0.594%
フランス10年債	-0.233%	-0.190%

米国債利回り	本日	前日
2年債	1.710%	1.734%
3年債	1.671%	1.684%
5年債	1.661%	1.683%
7年債	1.738%	1.770%
10年債	1.843%	1.893%
30年債	2.377%	2.442%

8/5 経済指標スケジュール	
09:30	【香港】7月購買部景気指数
10:00	【ニュージーランド】7月ANZ商品価格指数
10:45	【中国】7月財新メディア非製造業PMI
14:45	【スイス】7月SECO消費者信頼感指数
15:30	【スイス】6月実質小売売上高
16:00	【トルコ】7月消費者物価指数
16:00	【トルコ】7月生産者物価指数
16:50 ~ 17:30	【フランス】【ドイツ】【欧州】【英国】7月非製造業PMI
17:00	【英国】7月自動車登録台数
17:30	【英国】7月外貨準備高変化
17:30	【欧州】8月センチックス投資家信頼感
20:00	【メキシコ】7月消費者信頼感指数
22:45	【米国】7月非製造業PMI
23:00	【米国】7月ISM非製造業景況指数

8/5 主要会議・講演・その他予定

主要な米経済指標結果

7月米雇用統計

失業率 3.7% (予想 3.7%・前回 3.7%)

非農業部門雇用者数 +16.4万人 (予想 +16.5万人・前回 +22.4万人⇒+19.3万人)

民間部門雇用者数 +14.8万人 (予想 +16.5万人・前回 +19.1万人⇒+17.9万人)

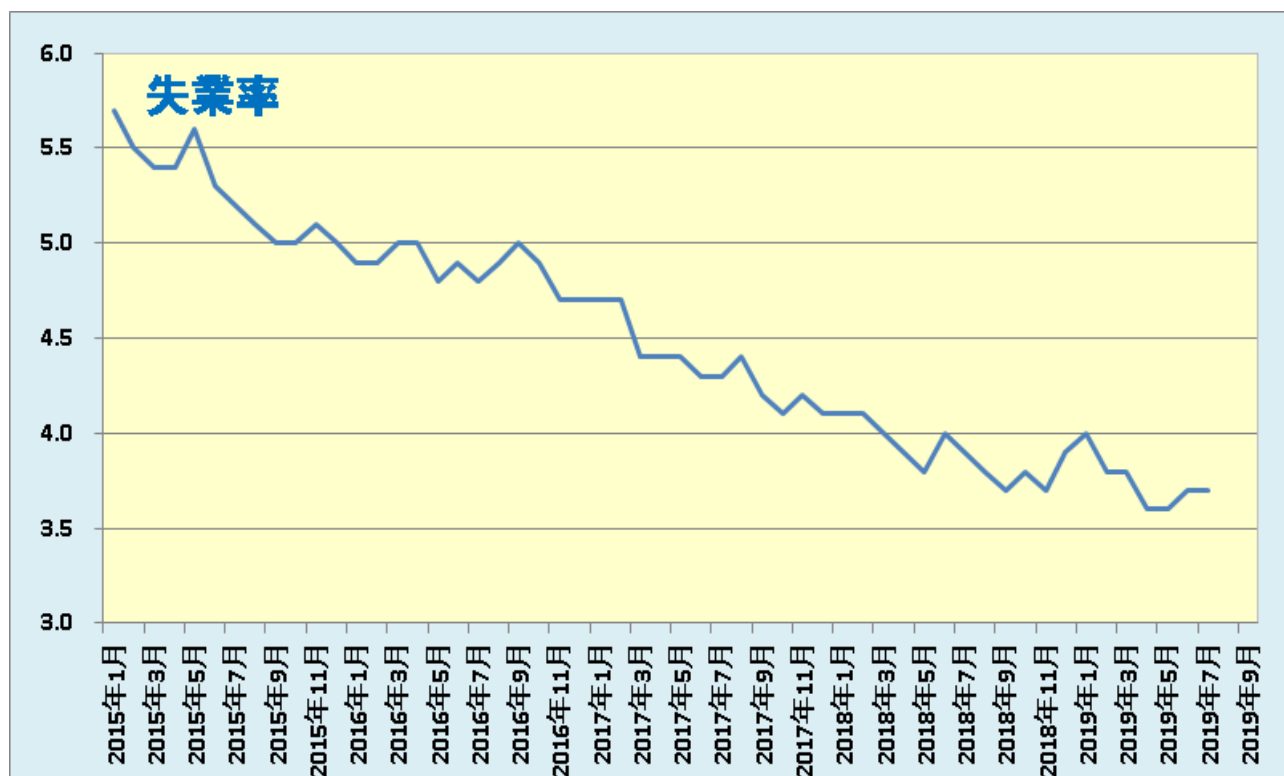
製造業雇用者数 +1.6万人 (予想 +0.5万人・前回 +1.7万人⇒+1.2万人)

平均時給 (前月比) 0.3% (予想 0.2%・前回 0.2%⇒0.3%)

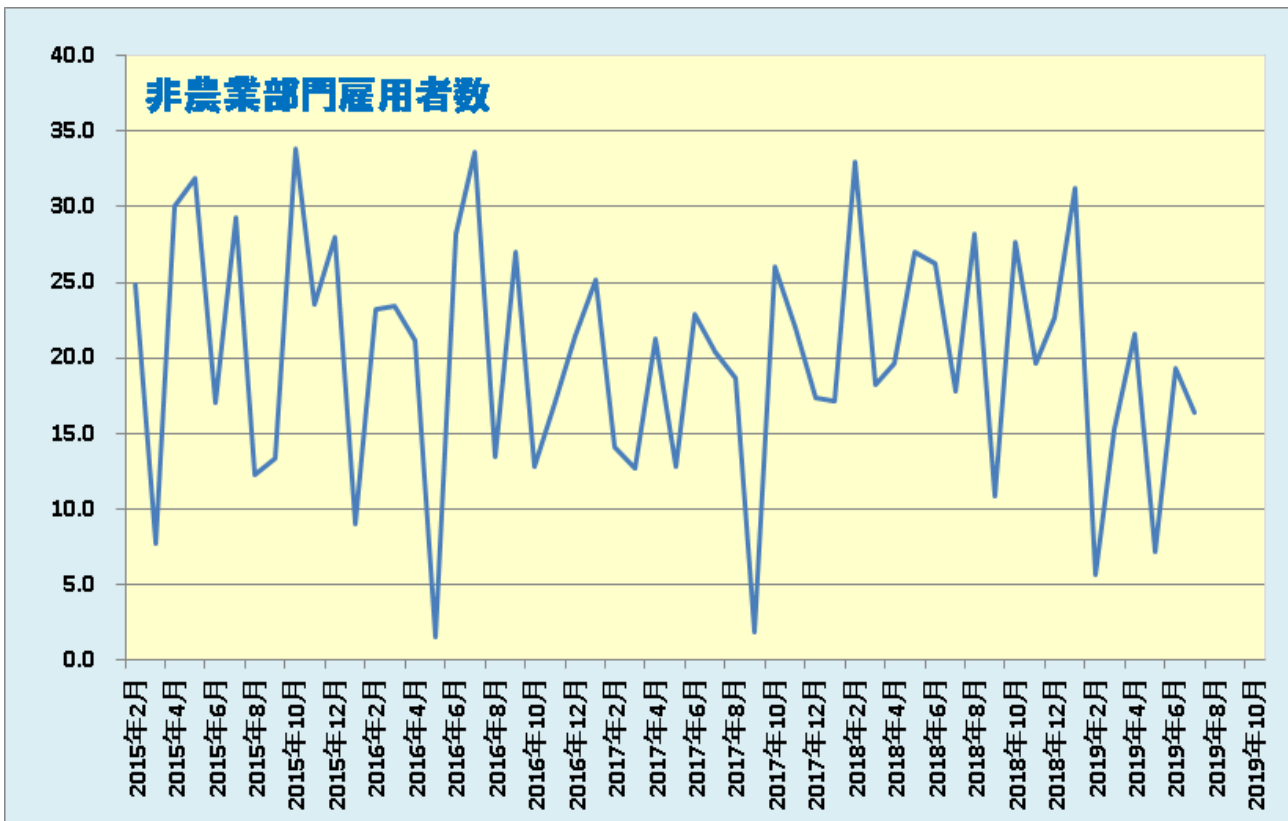
平均時給 (前年比) 3.2% (予想 3.1%・前回 3.1%)

労働参加率 63.0% (予想 62.9%・前回 62.9%)

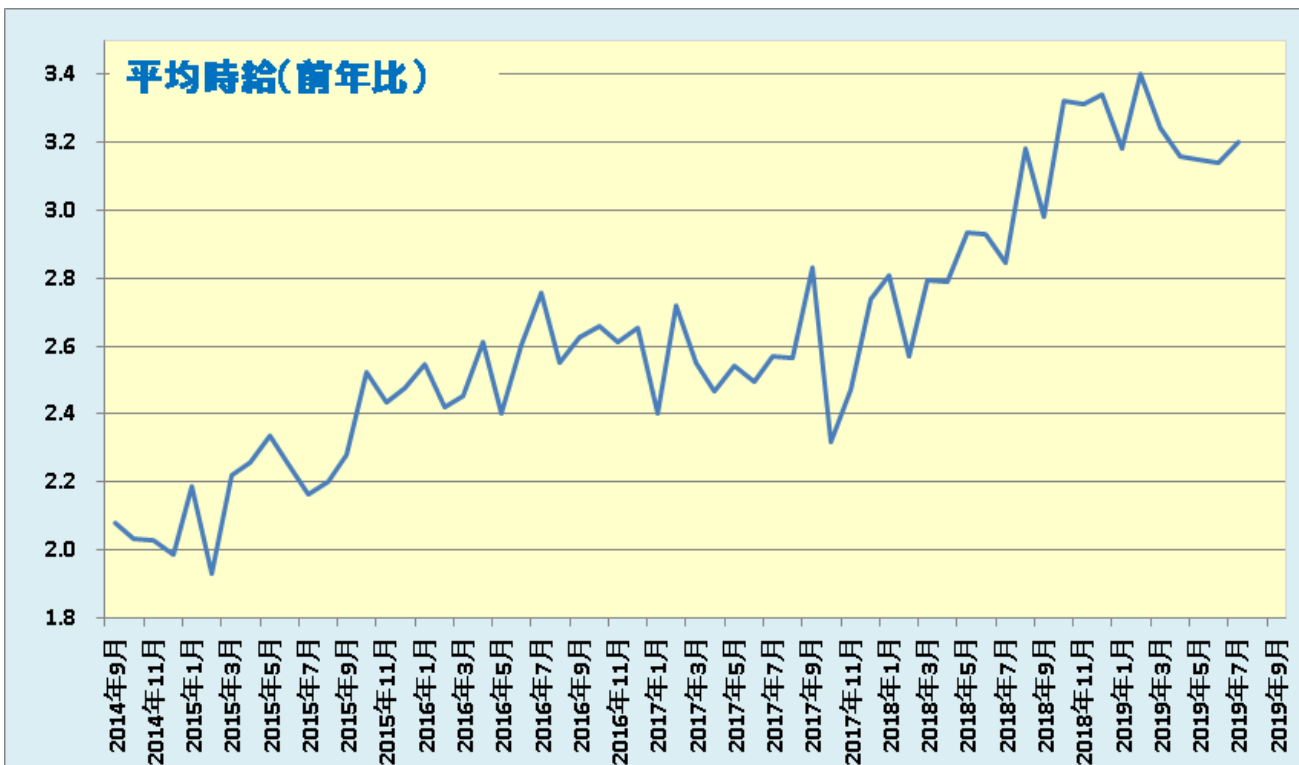
7月の米雇用統計では、非農業部門雇用者数がほぼ市場予想と一致したものの、失業率は労働参加率の上昇も影響し3.7%となった。一方、フルタイムを希望しながらもパート職に甘んじる広義の失業率 (U6) も7.0%と、前月から低下した。一方、7月の民間部門雇用者数は予想を下回り、製造業は+1.6万人、建設業は+0.4万人、鉱業・林業は-0.5万人となった。また、サービス部門は+13.3万人、小売業は+0.4万人、一時雇用を含む企業専門サービスは+3.8万人。政府部門は+1.6万人だった。自発的離職率は13.5%と前月から低下、また失業期間が半年以上の長期失業者数は-24.8万人の116.6万人と総じて堅調な労働市場が継続していることを確認する内容となった。



データを基に SBILM が作成



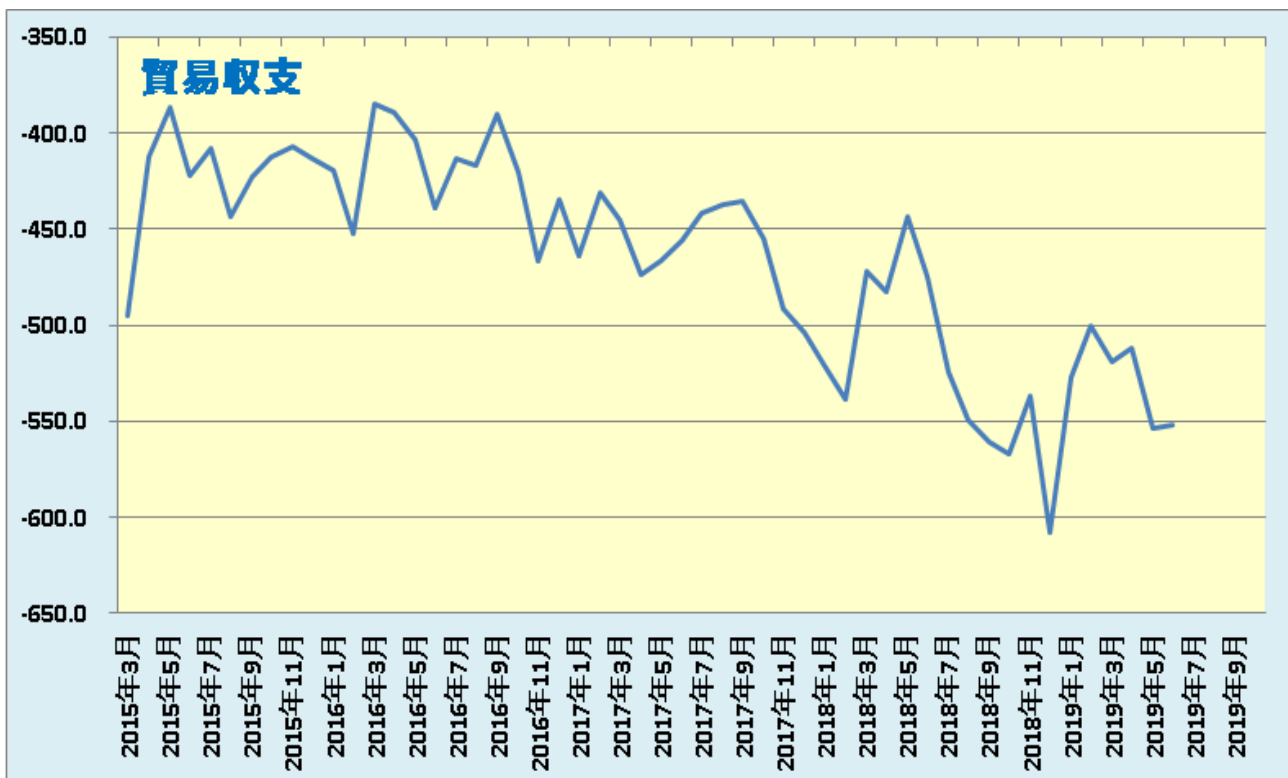
データを基に SBILM が作成



データを基に SBILM が作成

6月貿易収支 -552億USD（予想 -546億USD・前回 -555億USD⇒-553億USD）

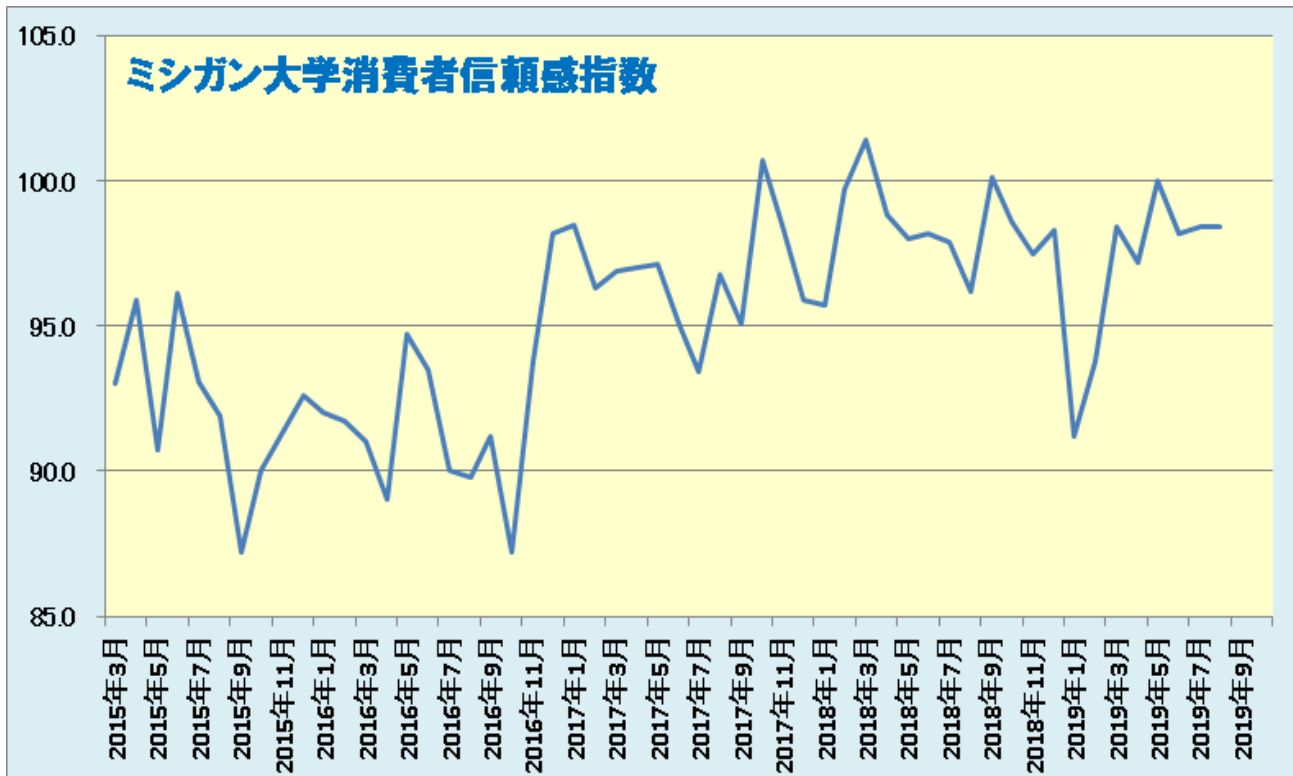
6月の米貿易収支では、赤字額が前月比-0.3%なり、市場予想を上回った。6月の輸出総額は-2.1%の2063億ドル、輸入総額は-1.7%の2615億ドル。モノの貿易赤字は-1.0%の751億2100万ドル。国・地域別では、対日赤字は+6.8%の571億ドル、対中赤字は-0.8%の300億ドル、対EU赤字は-18.4%の140億ドルだった。



データを基に SBILM が作成

7月ミシガン大学消費者信頼感指数 98.4（予想 98.5・前回 98.4）

7月の米ミシガン大学消費者信頼感指数の確報値は、速報値から変わらずとなったが、前月比で0.2ポイントの上昇となった。現状指数は110.7と7月速報値から0.4ポイント、前月から1.2ポイント低下、先行指数は90.5と7月速報値から0.4ポイント、前月から1.2ポイント上昇した。1年後のインフレ期待は2.6%と7月速報値から変わらず、前月から0.1ポイント低下した。



データを基に SBILM が作成

ダウ平均、ナスダックは 6/18 以来約 1 ヶ月半ぶりの安値

米株式市場は、トランプ米大統領が対中制裁関税第 4 弾を発動する意向を表明したことに対して、中国は報復措置の検討を表明したことから、米中貿易対立が世界経済に悪影響を及ぼすとの警戒感が広がり、主要株価指数は下落した。ダウ平均株価は、序盤から軟調な動きとなり、一時前日比 334 ドル安まで下落したものの、9 月 FOMC での利下げ観測を背景に下げ幅を縮小し、98 ドル安で終了した。一方、ハイテク株中心のナスダックは 107 ポイント安で終了し、6/18 以来約 1 ヶ月半ぶりの安値となった。



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	-2.67%	1	シスコシステムズ	-3.86%
2	テクノロジー	-1.93%	2	DOW	-2.67%
3	消費財	-0.78%	3	ナイキ	-2.38%
4	石油・ガス	-0.37%	4	アップル	-2.12%
5	金融	-0.34%	5	IBM	-2.04%

データを基に SBILM が作成

ドル/円は 1/3 以来の安値を更新

NY 市場では、序盤に発表された米雇用統計で賃金の伸びが前月比・前年比ともに前月を上回る伸びとなったことに加え、トランプ大統領が対中制裁関税発動の停止・延期に対してオープンであるとの認識を示したとの報道が好感され、ドル/円は一時 107.28 まで反発した。その後、クドロー米国家経済会議委員長が、対中追加関税の延期の可能性は聞いていないと発言、米中の貿易対立が世界経済に悪影響を及ぼすとの警戒感が再燃、投資家のリスク回避の動きが強まり、相対的に安全な通貨とされる円買いが優勢となり、ドル/円は、米 10 年債利回りの 1.9052% から 1.78410% への低下も影響し 106.51 まで下落し、1/3 日以来の安値を更新した。



出所：総合分析チャート

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。

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

先週末2日のルーブルは対ドルで65.4125ルーブルと対ドルで下落したほか、対円でも1.6283円と下落した。米中間の貿易問題を巡る対立懸念を背景に世界経済の減速懸念が嫌気される中、ロシア株式市場の下落も嫌気され、対ドルで4月末以来の安値まで下落した。

一方、ドル建のロシア RTS 株価指数は53.21Pts 安の1,293.19Pts と下落したほか、MOEX 指数も2,674.90Pts (54.52 Pts 安) と続落した。米国による対中関税に対する中国側からの報復措置検討の報道が投資家心理の警戒につながったほか、ブレント原油の下落も影響した。

◇ブラジルレアル

レアルは対ドルで3.8908レアル、対円でも27.428円と対ドル、対円で下落した。トランプ大統領による対中制裁関税を巡り、中国側の報復措置検討の報道も両国間の対立激化を通じた世界経済の減速懸念につながるとの警戒感を背景に新興国通貨であるレアル安につながった。

一方、ボベスパ指数は547.74Pts 高の102,673.74Pts と続伸した。ブラジル国営石油会社のペトロプラスの四半期決算が過去最高を更新したことが好感されたほか、年金改革法案の進展期待がボベスパ指数の上昇を牽引した。