

NYマーケットレポート (2020年7月16日)

2020年7月16日(木)

| アジア主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|-----------|-----------|---------|---------|
| 日経平均 | 22,770.36 | -175.14 | -3.75% |
| ハンセン指数 | 24,970.69 | -510.89 | -11.42% |
| 上海総合 | 3,210.10 | -151.21 | 5.25% |
| 韓国総合 | 2,183.76 | -18.12 | -0.63% |
| 豪ASX200 | 6,010.86 | -42.06 | -10.07% |
| シンガポールST | 2,623.67 | -25.23 | -18.59% |
| インドSENSEX | 36,471.68 | +419.87 | -11.59% |

| 外国為替 | 終値 | 高値 | 安値 |
|---------|--------|--------|--------|
| USD/JPY | 107.29 | 107.40 | 106.83 |
| EUR/JPY | 122.13 | 122.50 | 121.82 |
| GBP/JPY | 134.66 | 135.17 | 134.06 |
| AUD/JPY | 74.80 | 75.10 | 74.68 |
| EUR/USD | 1.1383 | 1.1442 | 1.1371 |
| BRL/JPY | 19.944 | 20.128 | 19.661 |
| RUB/JPY | 1.487 | 1.503 | 1.486 |

| | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|----------------|------------|----------|---------|
| 英FT100 | 6,250.69 | -41.96 | -17.13% |
| 仏CAC40 | 5,085.28 | -23.70 | -14.93% |
| 独DAX | 12,874.97 | -56.70 | -2.82% |
| スペインIBX35 | 7,474.70 | -12.90 | -21.72% |
| イタリアFTSE MIB | 20,356.09 | +74.71 | -13.40% |
| トルコ・イスタンブール100 | 118,807.53 | +1066.43 | 3.83% |
| ロシアRTS | 1,219.93 | +0.67 | -21.24% |
| 南ア全株指数 | 55,729.45 | -217.60 | -2.37% |

| コモディティ | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|---------|---------|--------|---------|
| NY GOLD | 1800.30 | -13.50 | 18.20% |
| NY 原油 | 40.75 | -0.45 | -33.26% |
| CBOTコーン | 330.25 | +4.00 | -14.83% |
| CRB指数 | 140.816 | -0.404 | -24.21% |
| ドル指数先物 | 96.346 | +0.265 | -0.04% |
| VIX指数 | 28.00 | +0.24 | 103.19% |

| Crypto Currency | 本日 | 前日 |
|--------------------|--------|--------|
| CME Bitcoin(先物・期近) | 9115 | 9235 |
| Ripple (BSTP) | 0.192 | 0.198 |
| Ethereum (BSTP) | 231.57 | 238.44 |
| Bitcoin Cash | 222.61 | 227.80 |

| 米国主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|--------|-----------|---------|--------|
| 米ダウ平均 | 26,734.71 | -135.39 | -6.32% |
| S&P500 | 3,215.57 | -10.99 | -0.47% |
| NASDAQ | 10,473.83 | -76.66 | 16.73% |

| 南北米主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|-------------|------------|----------|---------|
| カナダ・トロント総合 | 16,024.50 | -38.83 | -6.09% |
| メキシコ・ボルサ指数 | 36,465.67 | -124.59 | -16.25% |
| ブラジル・ボベスパ指数 | 100,553.27 | -1237.27 | -13.05% |

| 日本国債利回り | 本日 | 前日 |
|---------|---------|---------|
| 2年債 | -0.143% | -0.133% |
| 5年債 | -0.099% | -0.096% |
| 10年債 | 0.026% | 0.035% |
| 30年債 | 0.594% | 0.613% |

| 欧州国債利回り | 本日 | 前日 |
|-----------|---------|---------|
| ドイツ10年債 | -0.465% | -0.444% |
| 英国 10年債 | 0.139% | 0.166% |
| フランス 10年債 | -0.150% | -0.130% |

| 米国債利回り | 本日 | 前日 |
|--------|--------|--------|
| 2年債 | 0.145% | 0.155% |
| 3年債 | 0.172% | 0.180% |
| 5年債 | 0.275% | 0.288% |
| 7年債 | 0.459% | 0.470% |
| 10年債 | 0.617% | 0.630% |
| 30年債 | 1.308% | 1.332% |

| 7/17 経済指標スケジュール |
|----------------------------|
| 09:30 【シンガポール】6月電子機器輸出 |
| 09:30 【シンガポール】6月輸出[除石油] |
| 17:00 【ポーランド】6月雇用 |
| 17:00 【ポーランド】6月平均総賃金 |
| 18:00 【欧州】5月建設支出 |
| 18:00 【欧州】6月消費者物価指数 |
| 20:30 【トルコ】5月住宅価格指数 |
| 21:30 【米国】6月住宅着工件数 |
| 21:30 【米国】6月建設許可件数 |
| 21:30 【カナダ】5月卸売売上高 |
| 23:00 【米国】7月ミシガン大学消費者信頼感指数 |
| 01:00 【ロシア】6月実質小売売上高 |
| 01:00 【ロシア】6月失業率 |

| 7/17 主要会議・講演・その他予定 |
|-------------------------|
| ・ EU首脳会議 (～18日) |
| ・ ベイラーBOE総裁 講演 |
| ・ G20財務相・中央銀行総裁会議 (18日) |

*一部暫定値

NY 市場レポート（前日 21 時 00 分～午前 5 時 30 分まで）

主要な欧州経済指標の結果

欧州政策金利 0.00%（予想 0.00%・前回 0.00%）

上限政策金利[限界貸出金利] 0.25%（予想 0.25%・前回 0.25%）

下限政策金利[中銀預金金利] -0.50%（予想 -0.50%・前回 -0.50%）

ECB は定例理事会で、新型コロナウイルスへの緊急対策として打ち出した債券購入プログラムの買い取り枠、政策金利など主要な政策の現状維持を決定した。

ラガルド ECB 総裁の記者会見

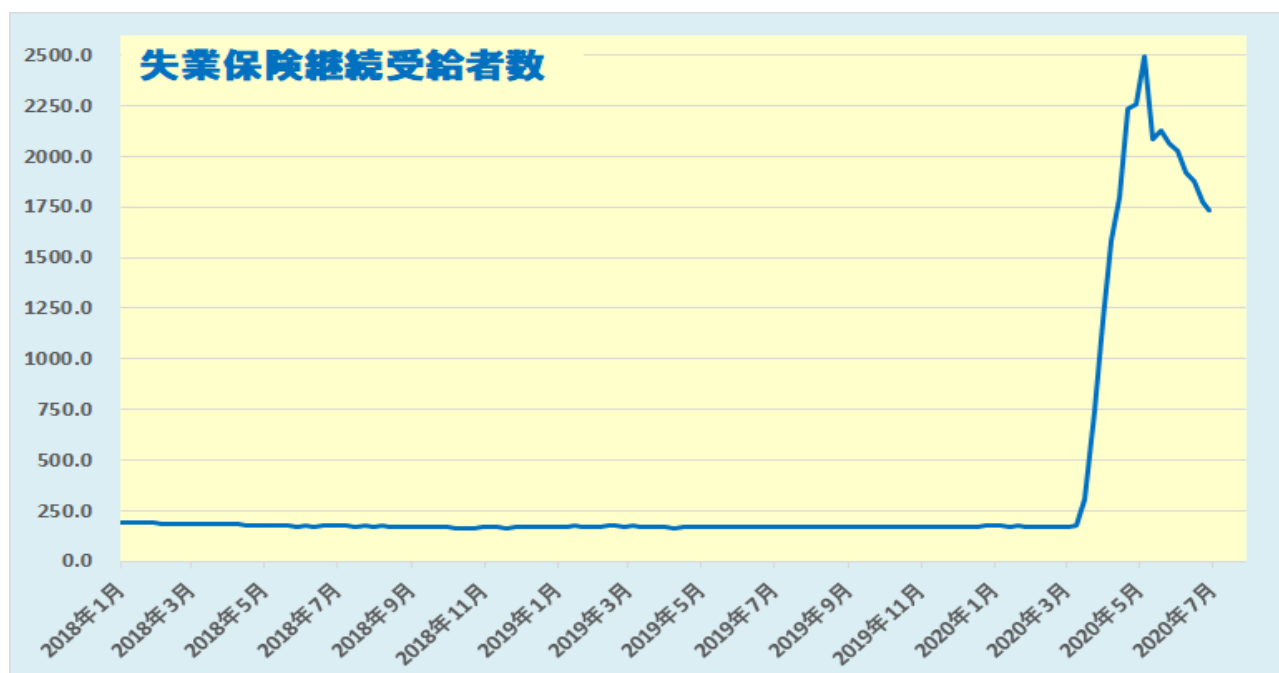
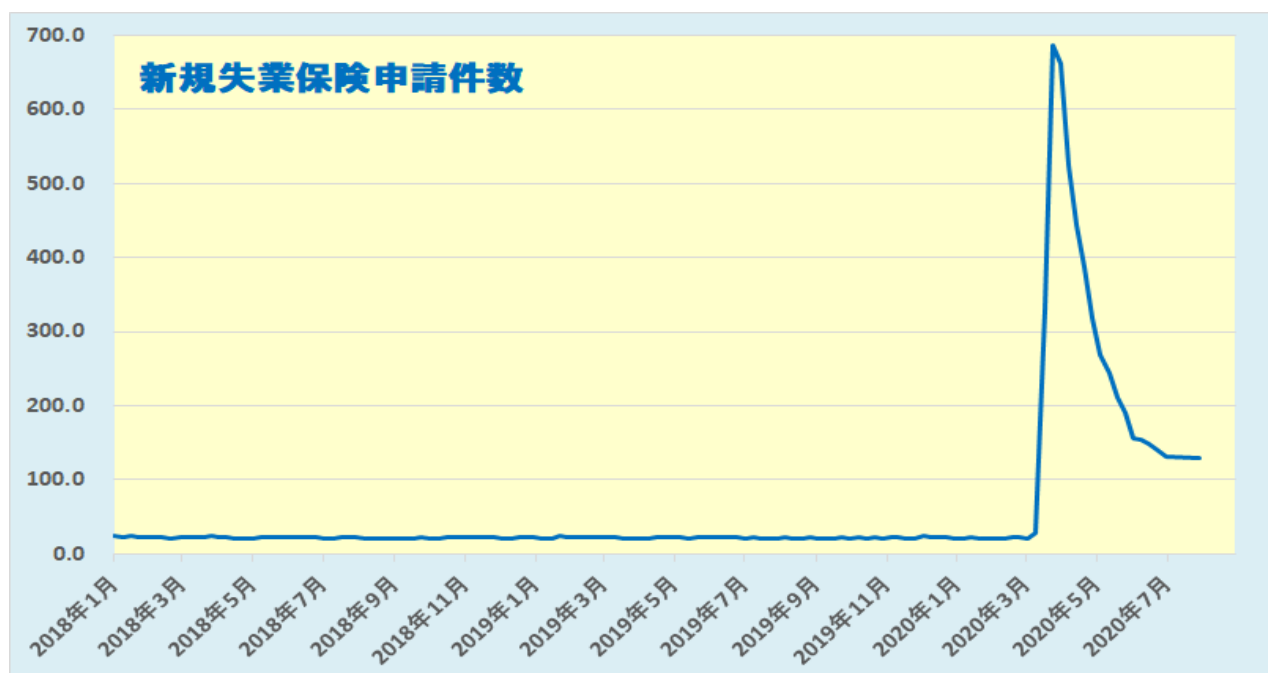
- ・ ECB は責務の範囲内で必要なことは何でもする
- ・ ECB は全ての政策手段を必要に応じ調整する用意
- ・ 4-6 月の経済縮小はほぼ予測通り
- ・ リスクは依然として下振れ方向
- ・ インフレ率は 2021 年初めに上昇へ
- ・ サプライズない限り PEPP（パンデミック緊急購入プログラム）全額を使い切る
- ・ ECB の想定は EU 復興基金が承認されることを前提
- ・ ECB の戦略検証、来年下半年に完了すると見込む

主要な米経済指標の結果

新規失業保険申請件数 130.0 万件（予想 125.0 万件・前回 131.4 万件⇒131.0 万件）

失業保険継続受給者数 1733.8 万人（予想 1755.0 万人・前回 1806.2 万人⇒1776.0 万人）

米新規失業保険申請件数は、15 週連続の減少となったものの、市場予想を上回り、前週比-1 万件と小幅な減少にとどまった。新型コロナウイルスの新規感染者数が再び増加したことが影響しており、回復の鈍化が鮮明になった。一方、失業保険継続受給者数は 6 週連続の減少となったものの、こちらも小幅な減少に留まっており、雇用情勢への影響が懸念されている。

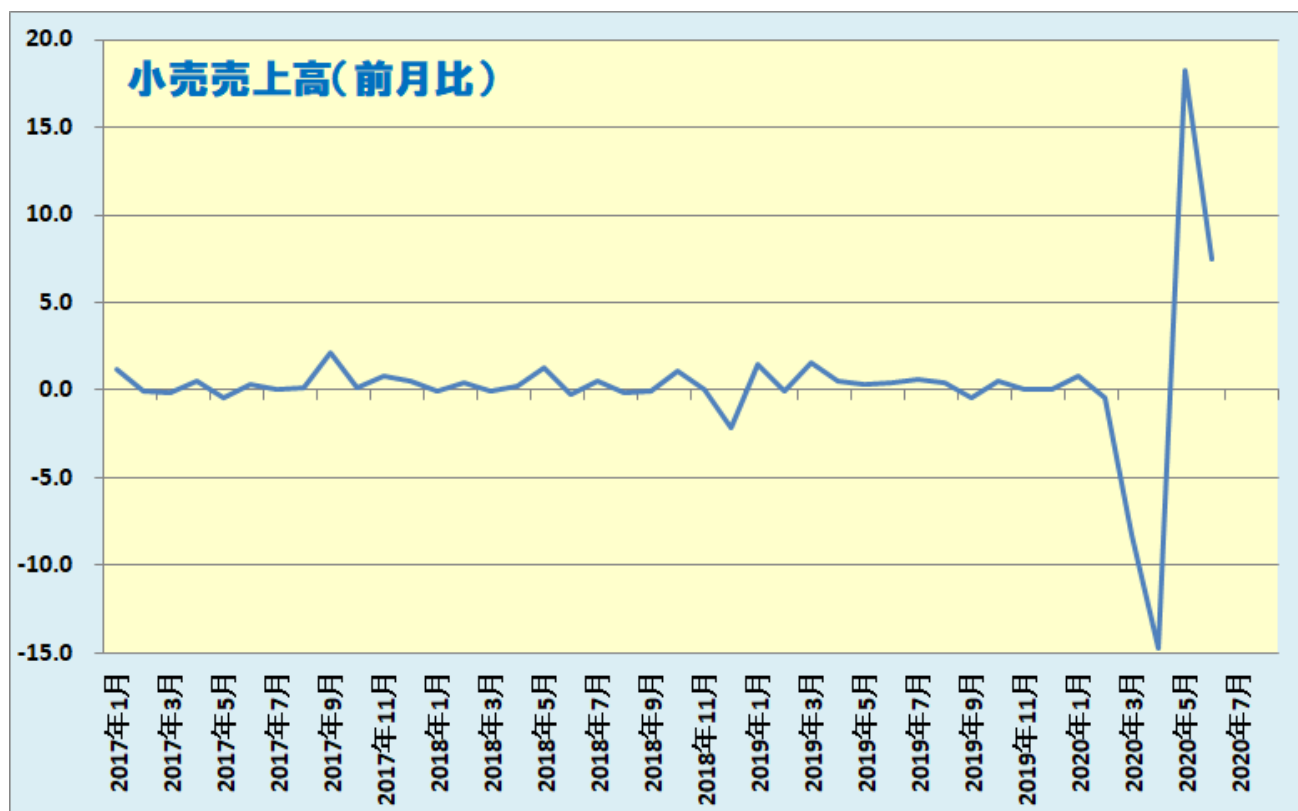


データを基に SBILM が作成

6月小売売上高（前月比） 7.5%（予想 5.0%・前回 17.7%⇒18.2%）

6月小売売上高[除自動車] 7.3%（予想 5.1%・前回 12.4%⇒12.1%）

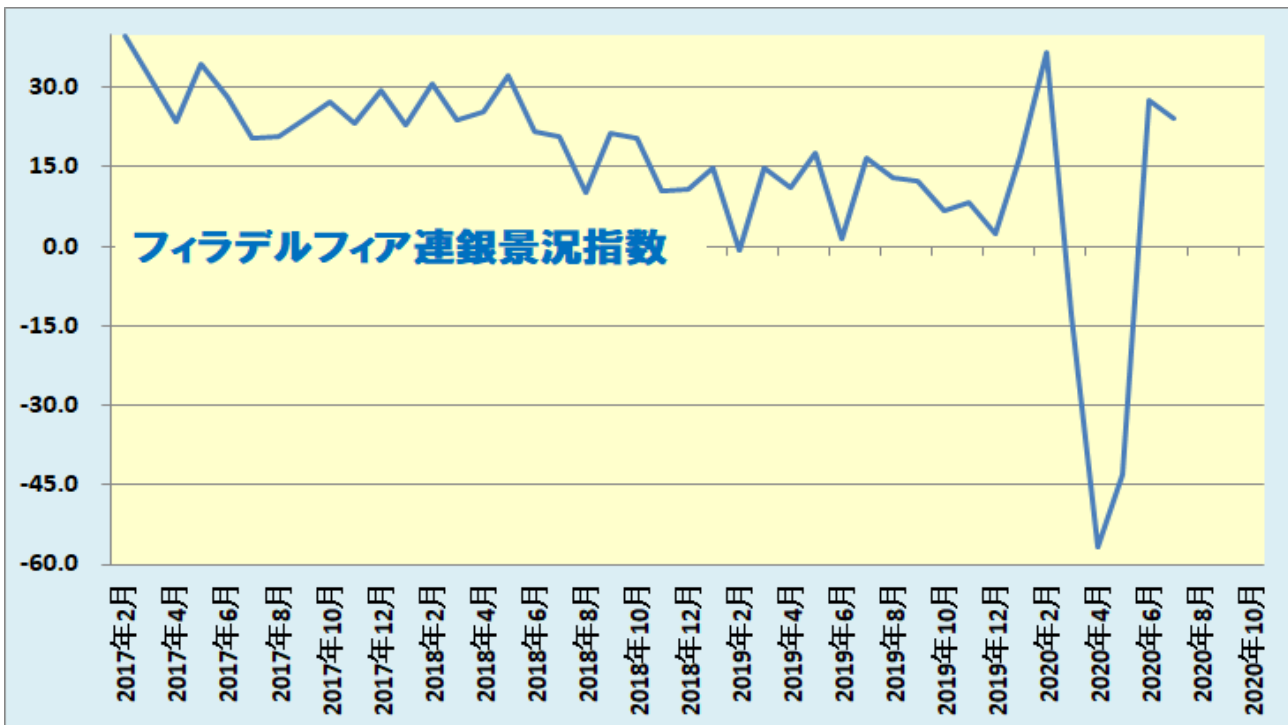
6月の米小売売上高は、市場予想を上回る伸びとなり、過去最大の伸びを記録した5月に続き2ヵ月連続のプラスとなった。経済活動の再開や失業手当、給付金の効果で消費が活性化したことが示された。家具は32.5%（前月79.1%）、電気製品は37.4%（36.5%）、ガソリンスタンドは15.3%（11.9%）、衣料品は105.1%（176.6%）、スポーツ・趣味・書籍は26.5%（78.0%）と伸びたものの、建設資材が-0.3%（12.2%、）食品・飲料が-1.2%（2.2%）とマイナスとなった。



データを基に SBILM が作成

7月フィラデルフィア連銀景況指数 24.1（予想 19.1・前回 27.5）

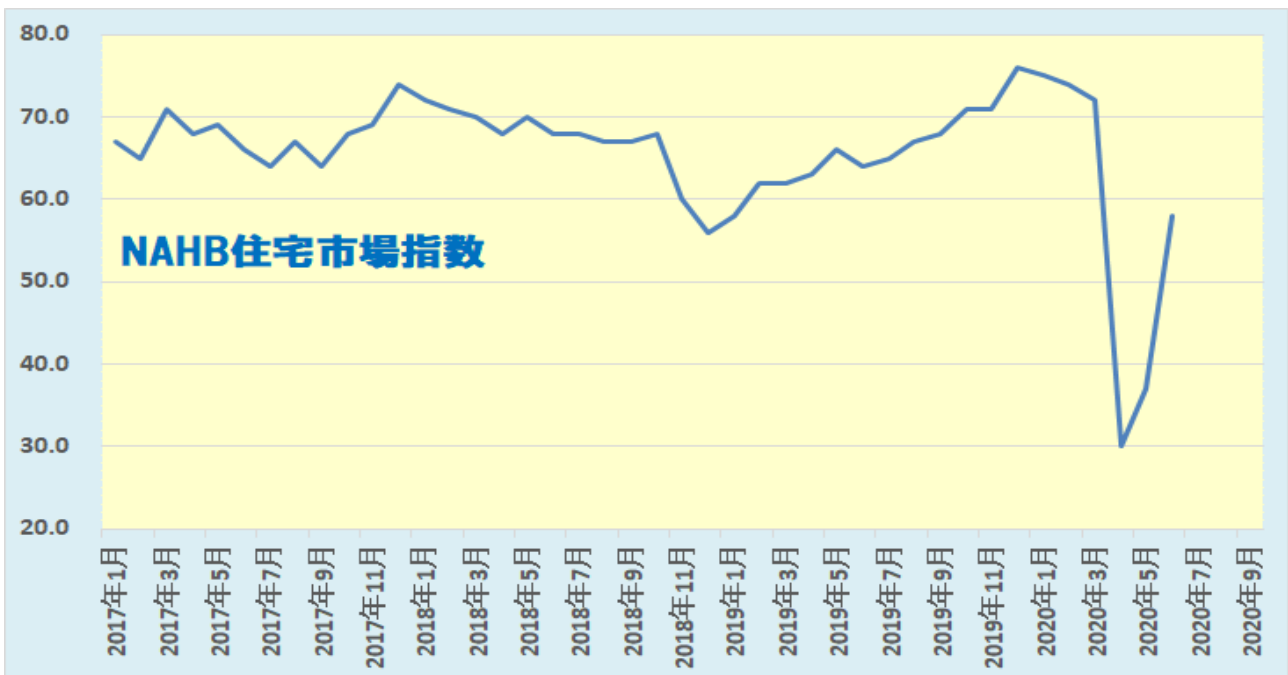
7月のフィラデルフィア連銀景況指数は、市場予想を上回る結果となり、前月から小幅の低下に留まった。新規受注は23.0（先月16.7）、仕入価格は15.7（11.1）、雇用者数は20.1（-4.3）と前月から上昇したことが下支え要因となった。ただ、6ヵ月先の予想では、景況指数が前月の66.3から36.0に低下し、4ヵ月ぶりの低水準に落ち込んだ。



データを基に SBILM が作成

7月 NAHB 住宅市場指数 72 (予想 60・前回 58)

7月のNAHB住宅市場指数は市場予想を大きく上回り、3月以来の水準に回復し、さらに昨年1年間の平均である66も上回る結果となった。現在の販売が79(前月63)、見通しが75(68)、見込み客足58(43)と3指数がいずれも上昇した。



データを基に SBILM が作成

ダウ平均株価は5営業日ぶり反落

米株式市場では、米国内で新型コロナウイルスの感染拡大が続いていることから、再び経済活動が停滞するとの懸念を背景に、主要株価指数は軟調な動きとなった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前日比280ドル安まで下落した。終盤にかけて下げ幅を縮小したものの、135ドル安(-0.50%)で終了して5営業日ぶりの反落となった。一方、ハイテク株中心のナスダックは、76ポイント安(-0.73%)で終了した。



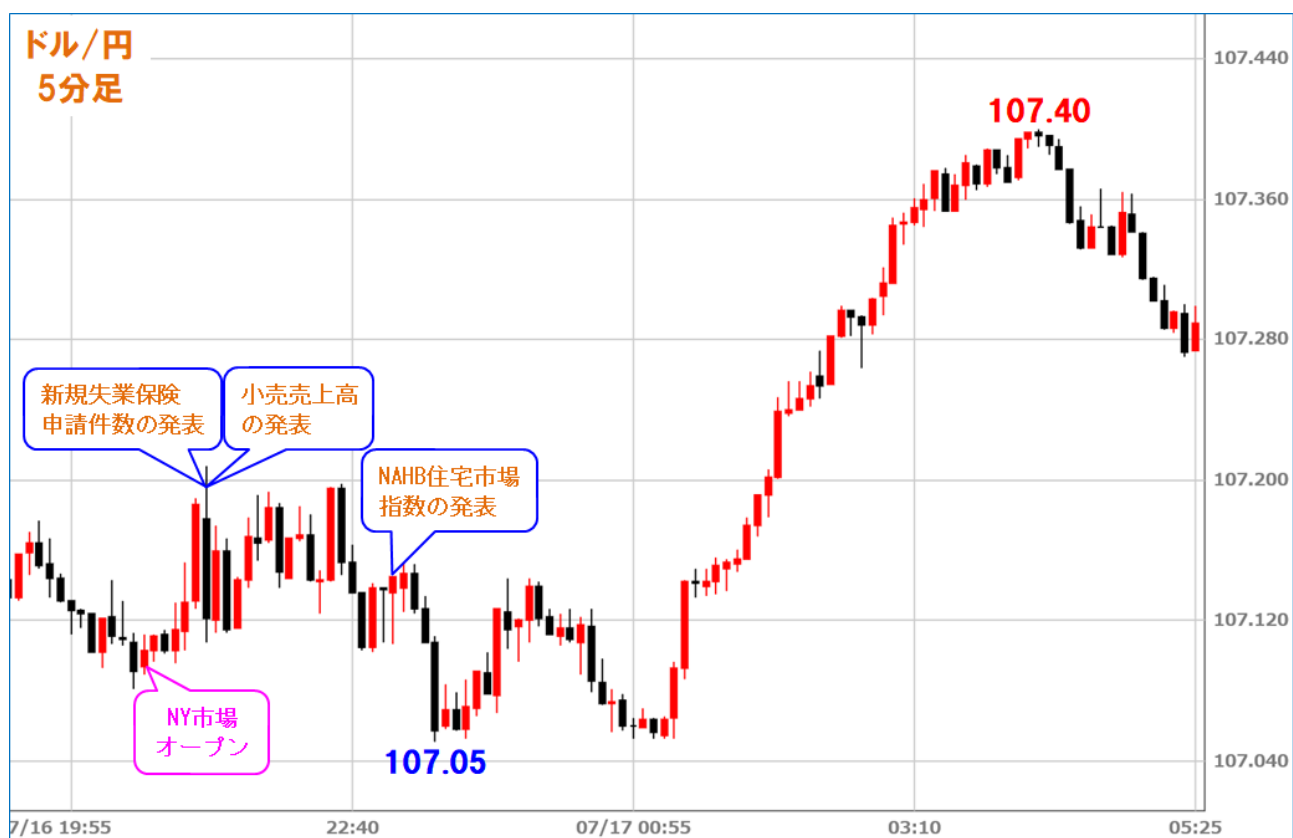
データを基に SBILM が作成

| 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 | 資本財 | -1.54% | 1 | ボーイング | -4.92% |
| 2 | テクノロジー | -1.02% | 2 | マイクロソフト | -1.98% |
| 3 | 石油・ガス | -0.66% | 3 | ビザ | -1.55% |
| 4 | 金融 | -0.64% | 4 | シスコシステムズ | -1.34% |
| 5 | 消費財 | -0.47% | 5 | ナイキ | -1.30% |

データを基に SBILM が作成

ドル/円は底固い動きも上値は限定的

NY市場では、欧州市場の流れを引き継ぎ、ドル円・クロス円は序盤から堅調な動きとなった。ユーロやポンドは対ドルで上昇となり、対円でも堅調な動きとなった。一方、ドルは序盤に発表された6月の小売売上高が市場予想を上回ったものの、失業保険申請件数が予想より冴えない結果となったこともあり、対円で上値の重い動きとなった。その後、米国で新型コロナウイルスの感染者が急増していることから、再び経済活動が停滞するとの懸念が広がり、米主要株価指数が下落するなど、投資家のリスク回避の動きが強まり、安全資産とされる円やドルが買われた。さらに、米国債利回りの上昇もあり、ドル/円は一時107.40まで上昇した。



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自身でお願いします。