

NY マーケットレポート (2020年7月31日)

2020年7月31日 (金)

アジア主要株価	終値	前日比	年初来%
日経平均	21,710.00	-629.23	-8.23%
ハンセン指数	24,595.35	-115.24	-12.75%
上海総合	3,310.01	+23.18	8.52%
韓国総合	2,249.37	-17.64	2.35%
豪ASX200	5,927.78	-123.30	-11.31%
シンガポールST	休場		#VALUE!
インドSENSEX	37,606.89	-129.18	-8.84%

*シンガポール市場はハリラヤハジ(犠牲祭)のため休場

外国為替	終値	高値	安値
USD/JPY	105.88	106.06	104.19
EUR/JPY	124.70	125.21	123.84
GBP/JPY	138.51	139.20	136.80
AUD/JPY	75.63	75.93	75.02
EUR/USD	1.1777	1.1909	1.1763
BRL/JPY	20.201	20.300	20.041
RUB/JPY	1.417	1.424	1.405

	終値	前日比	年初来%
英FT100	5,897.76	-92.23	-21.81%
仏CAC40	4,783.69	-69.25	-19.98%
独DAX	12,313.36	-66.29	-7.06%
スペインIBX35	6,877.40	-119.20	-27.98%
イタリアFTSE MIB	19,091.93	-136.54	-18.78%
トルコ・イスタンブール100	休場		#VALUE!
ロシアRTS	1,234.44	+2.09	-20.30%
南ア全株指数	55,721.80	-123.10	-2.39%

*トルコ市場はハリラヤハジ(犠牲祭)のため休場

コモディティ	終値	前日比	年初来%
NY GOLD	1985.90	+19.10	30.39%
NY 原油	40.27	+0.35	-34.05%
CBOTコーン	315.12	-0.88	-18.73%
CRB指数	143.690	+0.92	-22.66%
ドル指数先物	93.460	+0.44	-3.04%
VIX指数	24.46	-0.30	77.50%

	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	26,428.32	+114.67	-7.39%
S&P500	3,271.12	+24.90	1.25%
NASDAQ	10,745.27	+157.46	19.76%
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%
カナダ・トロント総合	16,169.20	-130.09	-5.24%
メキシコ・ボルサ指数	37,019.68	-117.10	-14.98%
ブラジル・ボベスパ指数	102,912.24	-2096.46	-11.01%

*一部暫定値

Crypto Currency	本日	前日
CME Bitcoin(先物・期近)	11610	11165
Ripple (BSTP)	0.256	0.249
Ethereum (BSTP)	347.60	339.09
Bitcoin Cash	302.42	297.64

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.126%	-0.128%
5年債	-0.114%	-0.114%
10年債	0.020%	0.021%
30年債	0.532%	0.545%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	-0.529%	-0.542%
英国 10年債	0.109%	0.088%
フランス 10年債	-0.195%	-0.220%
米国債利回り		
2年債	0.109%	0.117%
3年債	0.117%	0.130%
5年債	0.209%	0.231%
7年債	0.388%	0.404%
10年債	0.533%	0.546%
30年債	1.196%	1.207%

8/3 経済指標スケジュール
08:50 【日本】1Q GDP
08:50 【日本】1Q GDPデフレーター
10:30 【オーストラリア】7月ANZ求人広告件数
10:45 【中国】7月財新メディア製造業PMI
14:00 【日本】7月自動車販売台数
15:30 【スイス】7月消費者物価指数
16:30 【スイス】7月製造業PMI
16:50 【フランス】7月製造業PMI
16:55 【ドイツ】7月製造業PMI
17:00 【欧州】7月製造業PMI
17:30 【英国】7月製造業PMI
18:00 【南アフリカ】7月製造業PMI
19:00 【南アフリカ】7月Naamsa自動車販売
22:00 【シンガポール】7月購買部景気指数
22:00 【シンガポール】7月電子産業指数
22:45 【米国】7月製造業PMI
23:00 【米国】7月ISM製造業景況指数
23:00 【米国】6月建設支出
03:00 【米国】7月貿易収支

8/3 主要会議・講演・その他予定
・シカゴ連銀総裁 会見

NY 市場レポート (前日 21 時 00 分～午前 5 時 30 分まで)

主要な米経済指標の結果

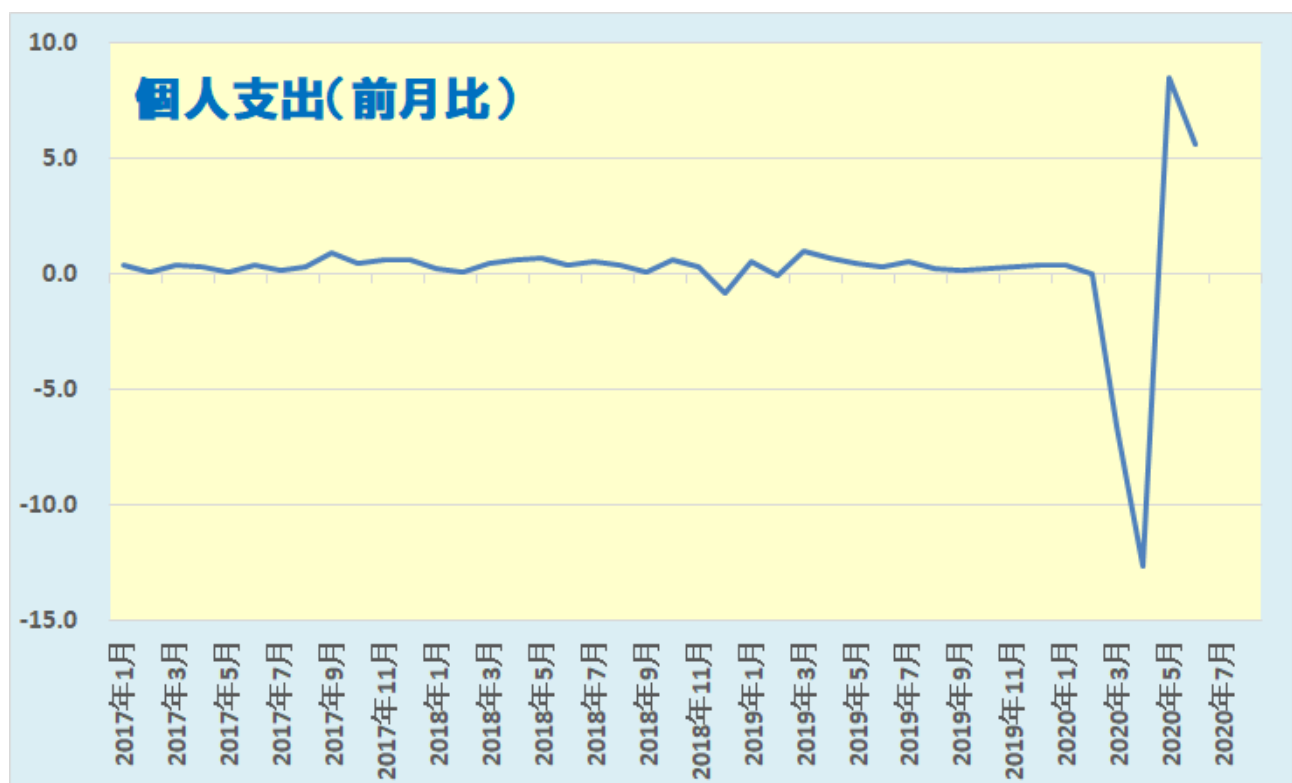
6 月 個人所得 (前月比) -1.1% (予想 -0.7%・前回 -4.2%⇒-4.4%)

6 月 個人支出 (前月比) 5.6% (予想 5.2%・前回 8.2%⇒8.5%)

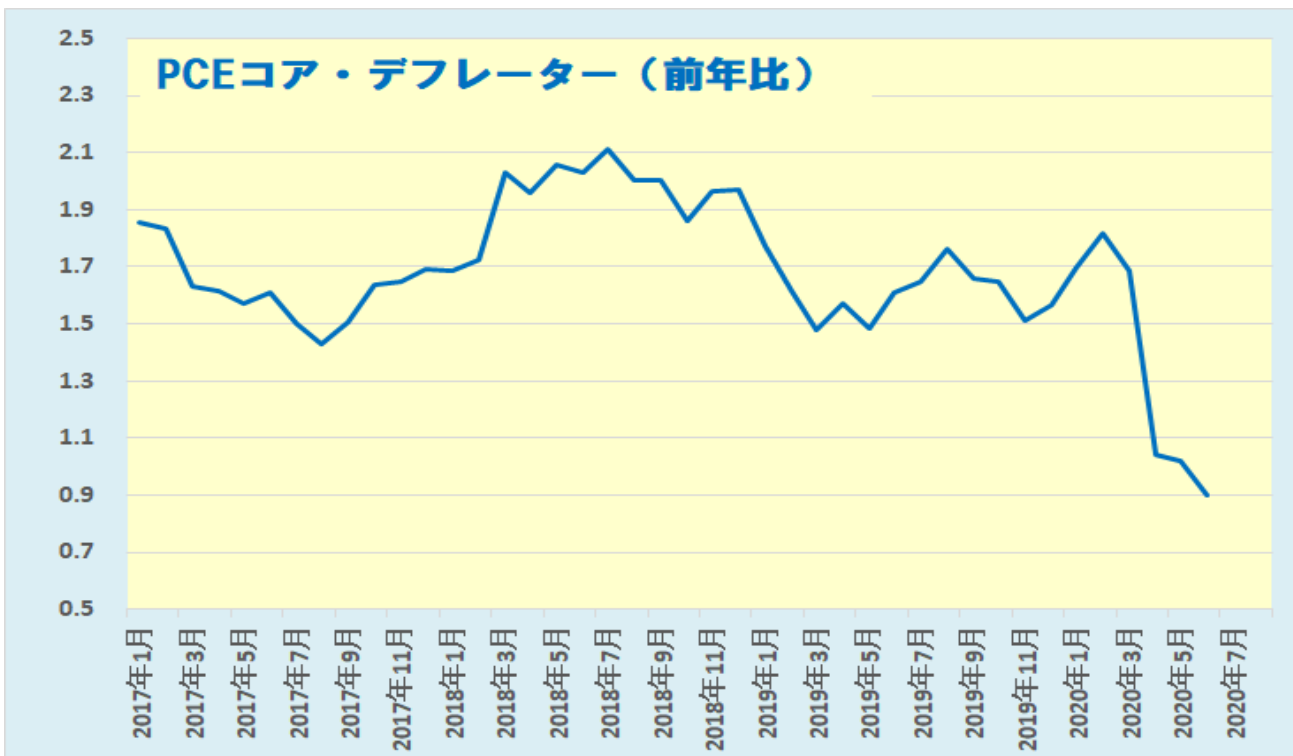
6 月 PCE デフレーター (前年比) 0.8% (予想 0.9%・前回 0.5%)

6 月 PCE コア・デフレーター (前年比) 0.9% (予想 1.0%・前回 1.0%)

6 月の米個人所得・支出統計では、個人支出が 2 ヶ月連続で上昇し、個人消費が持ち直していることが示された。ただ、個人所得は、政府からの給付の効果で 4 月に大幅上昇となった後は給付の効果も薄れて 2 ヶ月連続のマイナスとなった。今後の個人消費にも影響が出る可能性も指摘されている。



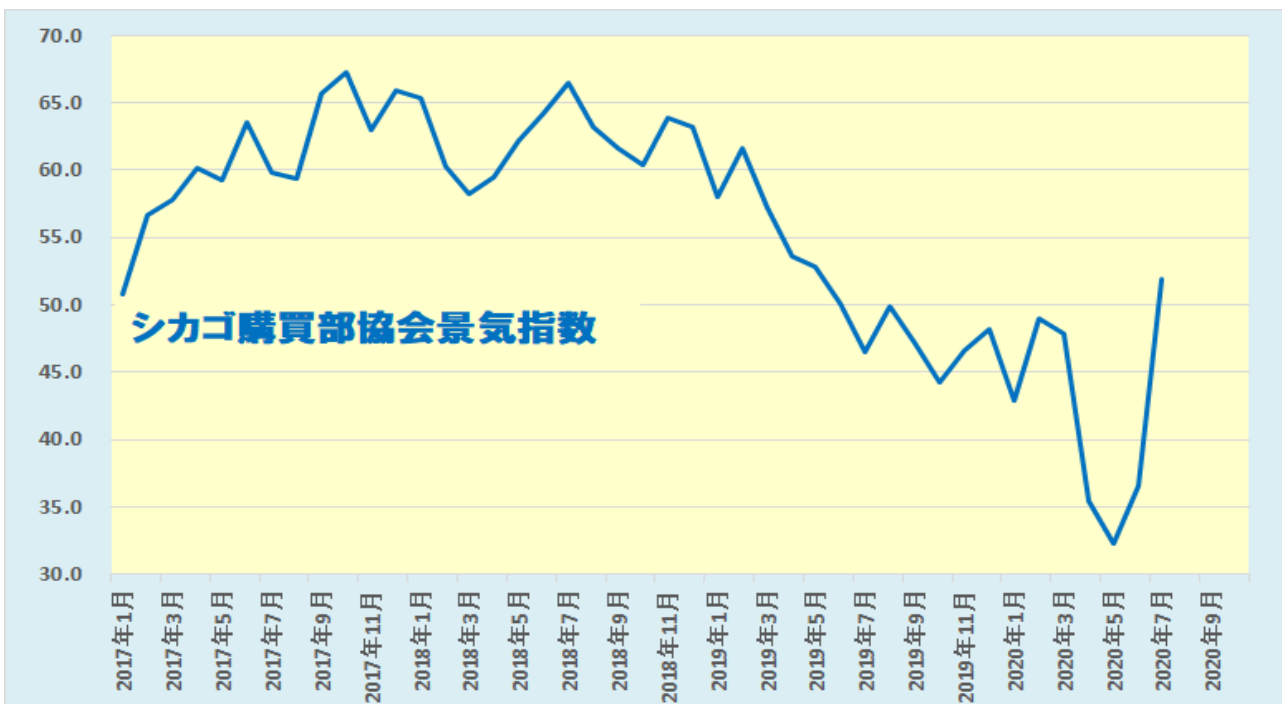
データを基に SBILM が作成



データを基に SBILM が作成

7月シカゴ購買部協会景気指数 51.9（予想 44.0・前回 36.6）

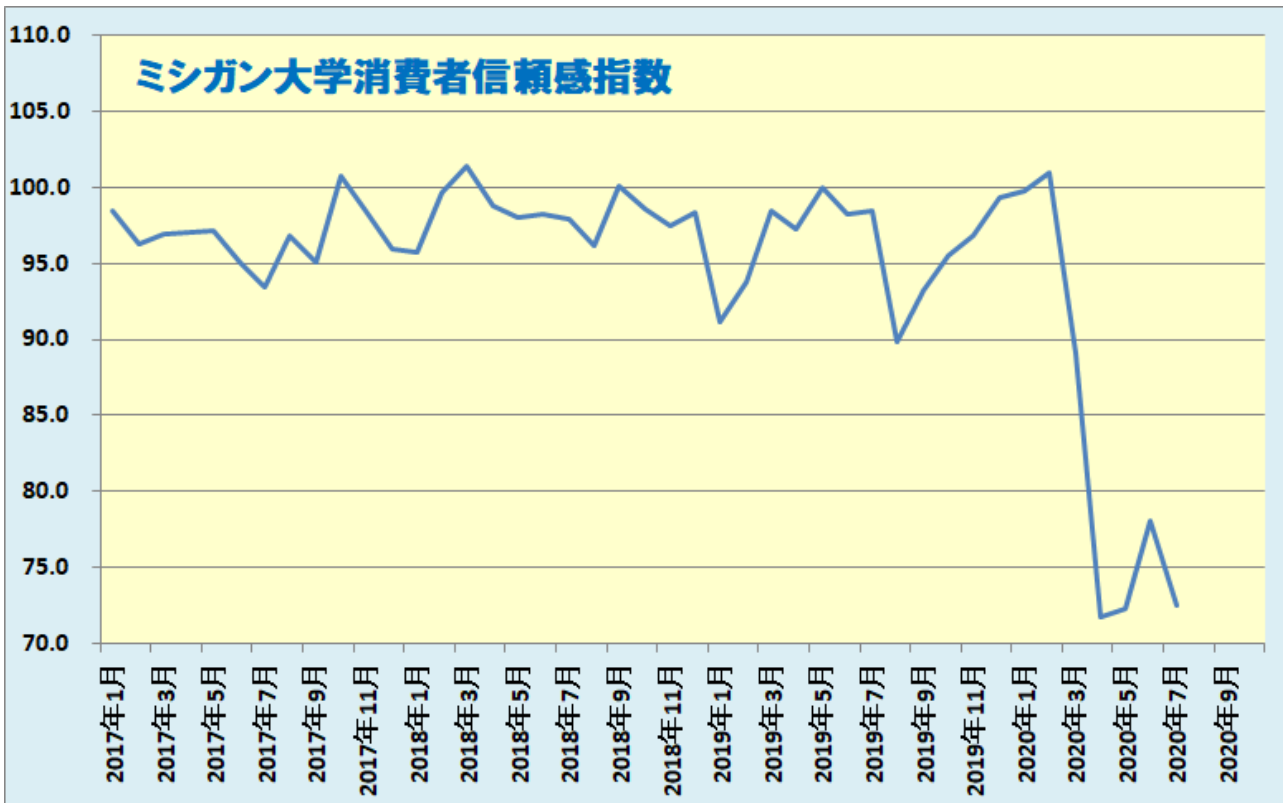
7月のシカゴ購買部協会景気指数は、市場予想を大幅に上回り、2019年5月以来の高水準となった。さらに、13ヵ月ぶりに景気拡大・縮小の判断基準となる50を上回った。



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 72.5 (予想 72.8・前回 73.2)

7月の米ミシガン大学消費者信頼感指数の速報値は、速報値から0.7ポイント低下し、市場予想も下回る結果となり、新型コロナウイルスの感染再拡大の影響で消費者のマインドが低下していることが示された。現状指数は82.8と7月速報値から1.4ポイント、前月から4.3ポイント低下、先行指数は65.9と7月速報値から0.3ポイント、前月から6.4ポイント低下した。一方、1年後のインフレ期待は3.0%で7月速報値から0.1ポイント低下し、前月からは横ばいだった。



データを基に SBILM が作成

ダウ平均、SP500 は反発、ナスダックは 3 営業日続伸

米株式市場では、追加の経済対策を巡る与野党の協議が難航していることから、新型コロナウイルスの感染拡大による経済活動停滞への懸念が圧迫要因となり、主要株価指数は序盤からやや上値の重い動きとなった。その後は、米企業の決算内容が好感されたこともあり、底固い動きが続いた。ダウ平均株価は、序盤から軟調な動きとなり、一時前日比 300 ドル安まで下落した。その後は下げ幅を縮小し、終盤にはプラス圏まで上昇し、114 ドル高 (+0.44%) で終了した。一方、ハイテク株中心のナスダックは、157 ポイント高 (+1.49%) で終了し、3 営業日続伸となった。



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	テクノロジー	5.08%	1	アップル	10.47%
2	通信サービス	0.31%	2	メルク	1.58%
3	ヘルスケア	0.03%	3	シスコシステムズ	1.42%
	石油・ガス	-1.82%		シェブロン	-2.70%
	資本財	-2.01%		キャタピラー	-2.82%

データを基に SBILM が作成

ドル/円は一時 106 円台回復

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。序盤に発表された米経済指標では、7月のシカゴ購買部協会景気指数が大幅な上昇となったものの、7月のミシガン大学消費者信頼感指数が予想以上の低下となるなど、まちまちの結果となったが、反応は限定的だった。ドル/円は東京時間に 104.19 まで下落し、3/12 以来の安値を更新していたものの、105 円台乗せまで回復すると、ストップロスも加わり、一段の上昇となった。その後、月末のロンドンフィキシングに向けたポジション調整の円売り・ドル買いが観測され、さらにユーロやポンドなどの欧州通貨や資源国通貨に対して一段の上昇となったことも加わり、ドル/円は一時 106.06 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。