

NY マーケットレポート (2020年8月27日)

※8/31-9/4の「NY マーケットレポート」は、諸事情により休刊とさせていただきます。

2020年8月27日(木)

アジア主要株価	終値	前日比	年初来%
日経平均	23,208.86	-82.00	-1.89%
ハンセン指数	25,281.15	-210.64	-10.32%
上海総合	3,350.11	+20.37	9.84%
韓国総合	2,344.45	-24.87	6.68%
豪ASX200	6,126.23	+9.87	-8.35%
シンガポールST	2,519.81	-22.27	-21.81%
インドSENSEX	39,113.47	+39.55	-5.19%

外国為替	終値	高値	安値
USD/JPY	106.58	106.70	105.61
EUR/JPY	126.00	126.09	125.14
GBP/JPY	140.72	140.86	139.70
AUD/JPY	77.36	77.43	76.60
EUR/USD	1.1822	1.1902	1.1764
BRL/JPY	18.979	19.115	18.658
RUB/JPY	1.410	1.416	1.391

	終値	前日比	年初来%
英FT100	5,999.99	-45.61	-20.45%
仏CAC40	5,015.97	-32.46	-16.09%
独DAX	13,096.36	-93.79	-1.15%
スペインIBX35	7,090.70	-32.30	-25.75%
イタリアFTSE MIB	19,847.38	-289.91	-15.57%
トルコ・イスタンブール100	1,108.93	+9.91	-3.09%
ロシアRTS	1,264.86	-9.38	-18.34%
南ア全株指数	56,869.67	+297.43	-0.38%

コモディティ	終値	前日比	年初来%
NY GOLD	1932.60	-19.90	26.89%
NY 原油	43.04	-0.35	-29.51%
CBOTコーン	358.50	+4.25	-7.54%
CRB指数	152.702	+0.246	-17.81%
ドル指数先物	93.001	-0.005	-3.51%
VIX指数	24.47	+1.20	77.58%

	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	28,429.27	+160.35	-0.38%
S&P500	3,484.55	+5.82	7.85%
NASDAQ	11,625.34	-39.72	29.56%
南北米主要株価			
カナダ・トロント総合	16,731.49	-58.48	-1.95%
メキシコ・ボルサ指数	37,647.19	-105.84	-13.54%
ブラジル・ボベスパ指数	100,623.64	-3.69	-12.99%

Crypto Currency	本日	前日
CME Bitcoin(先物・期近)	11305	11520
Ripple (BSTP)	0.262	0.278
Ethereum (BSTP)	379.48	389.51
Bitcoin Cash	262.65	276.80

8/28 経済指標スケジュール

08:30	【日本】8月消費者物価指数[東京都区部]
15:00	【ドイツ】9月GfK消費者信頼感調査
15:00	【ドイツ】7月輸入物価指数
15:45	【フランス】2Q GDP
15:45	【フランス】8月消費者物価指数
15:45	【フランス】7月生産者物価指数
15:45	【フランス】7月消費者支出
16:00	【スイス】8月KOF先行指数
16:00	【トルコ】8月経済信頼感
16:30	【スウェーデン】2Q GDP
17:00	【ノルウェー】8月失業率
18:00	【欧州】8月消費者信頼感
18:00	【欧州】8月サービス業信頼感
18:00	【欧州】8月経済信頼感
18:00	【欧州】8月鉱工業信頼感
21:00	【南アフリカ】7月財政収支
21:30	【米国】7月個人所得
21:30	【米国】7月個人支出
21:30	【米国】7月PCEデフレター
21:30	【米国】7月卸売在庫
21:30	【カナダ】6月GDP
22:45	【米国】8月シカゴ購買部協会景気指数
23:00	【米国】8月ミシガン大学消費者信頼感指数

*一部暫定値

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.113%	-0.101%
5年債	-0.079%	-0.075%
10年債	0.043%	0.046%
30年債	0.600%	0.608%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	-0.407%	-0.415%
英国 10年債	0.336%	0.302%
フランス 10年債	-0.120%	-0.130%
米国債利回り		
2年債	0.158%	0.150%
3年債	0.191%	0.175%
5年債	0.313%	0.285%
7年債	0.527%	0.483%
10年債	0.752%	0.688%
30年債	1.510%	1.413%

8/28 主要会議・講演・その他予定

- ・ジャクソンホール会議
- ・ベイリー英中銀総裁 講演(ジャクソンホール)

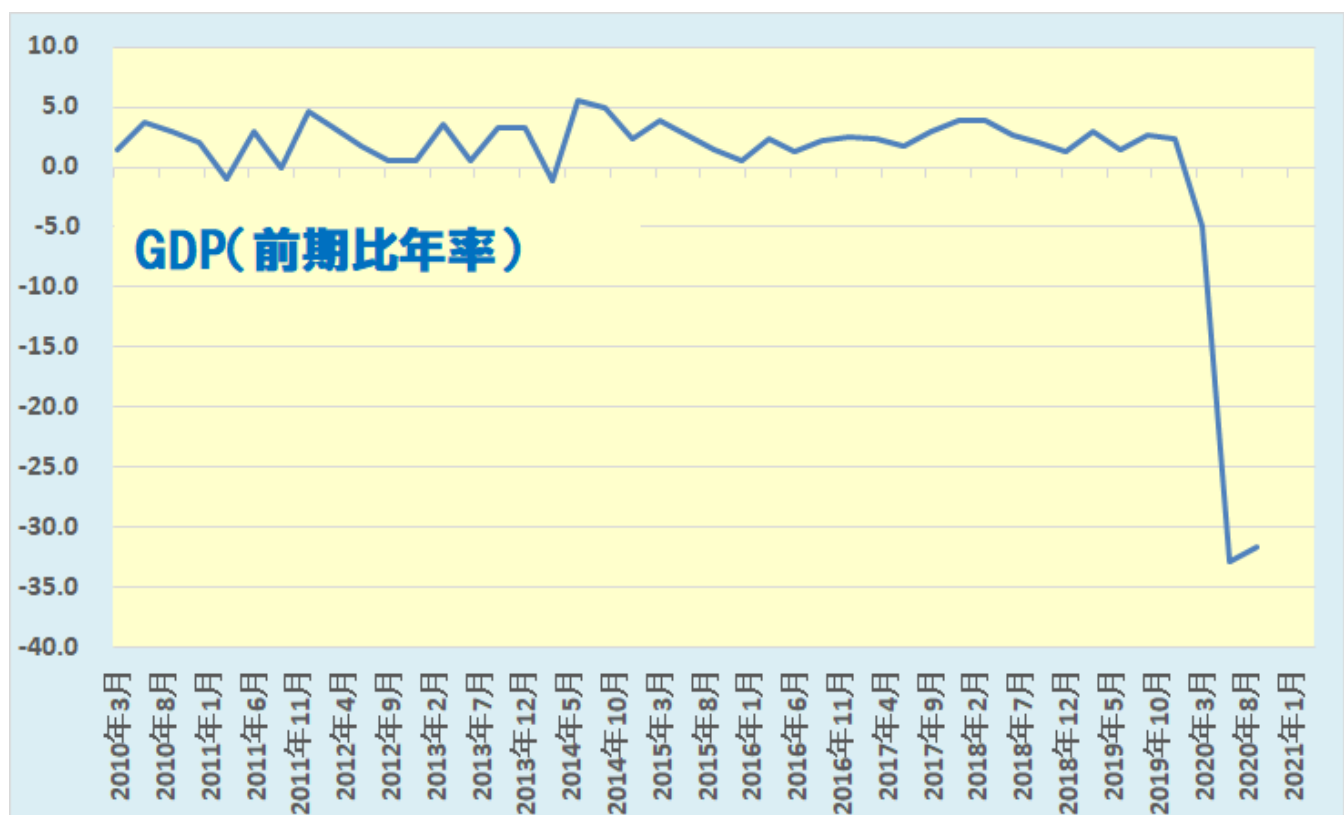
NY 市場レポート（前日 21 時 00 分～午前 5 時 30 分まで）

主要な米経済指標の結果

2Q GDP（前期比年率） -31.7%（予想 -32.5%・前回 -32.9%）

2Q 個人消費（前期比） -34.1%（予想 -34.6%・前回 -34.6%）

4-6 月期の米 GDP 改定値は、前期比-31.7%となり、速報値（-32.9%）から 1.2 ポイント上方修正された。一方、GDP の約 7 割を占める個人消費は-34.1%（速報値-34.6%）、設備投資は-26.0%（-27.0%）でそれぞれ上方修正された。新型コロナウイルス感染拡大の影響で、米景気の落ち込みが再確認された。

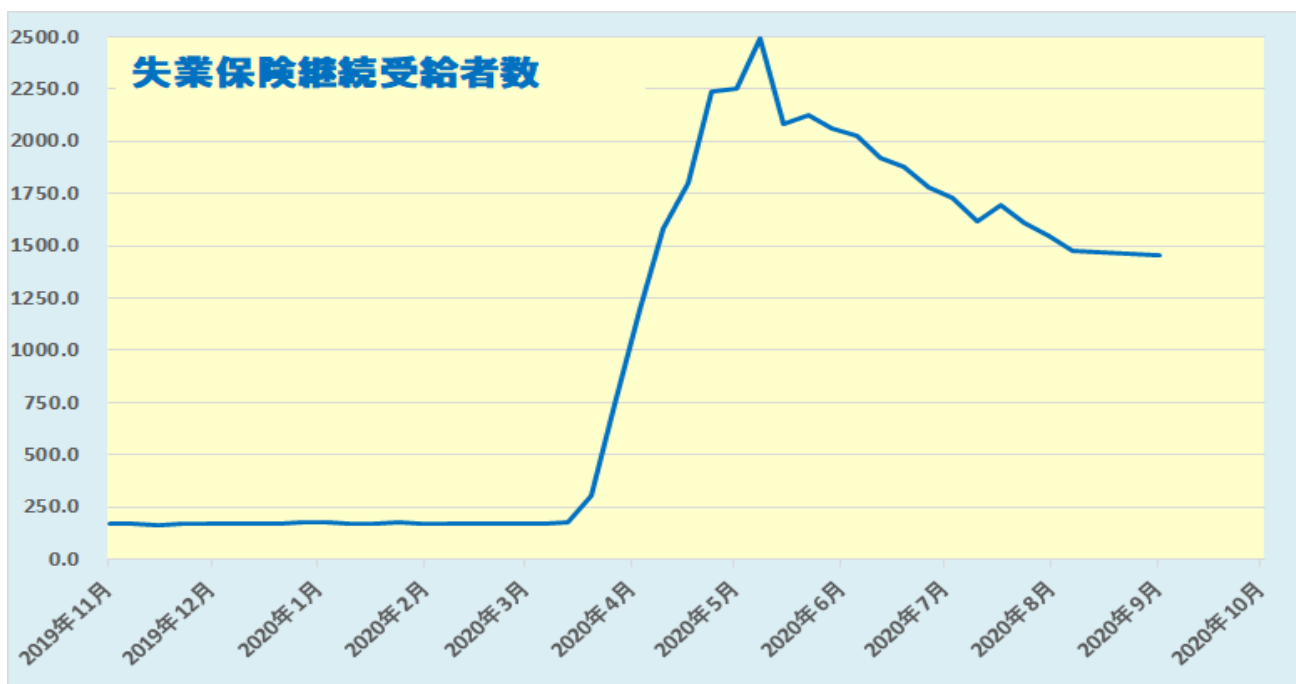


データを基に SBILM が作成

新規失業保険申請件数 100.6 万件（予想 100.0 万件・前回 110.6 万件⇒110.4 万件）

失業保険継続受給者数 1453.5 万人（予想 1440.0 万人・前回 1484.4 万人⇒1475.8 万人）

米新規失業保険申請件数（8/22 までの週）は、前週比-9.8 万件となり、2 週ぶりに減少した。ただ、100 万件を上回る結果となり、新型コロナウイルス感染拡大の影響で、高水準が続いている。一方、1 週遅れて発表される失業保険継続受給者数（8/15 までの週）は、前週比-22.3 万人となり、市場予想ほど減少しなかったものの、4 週連続の減少となった。

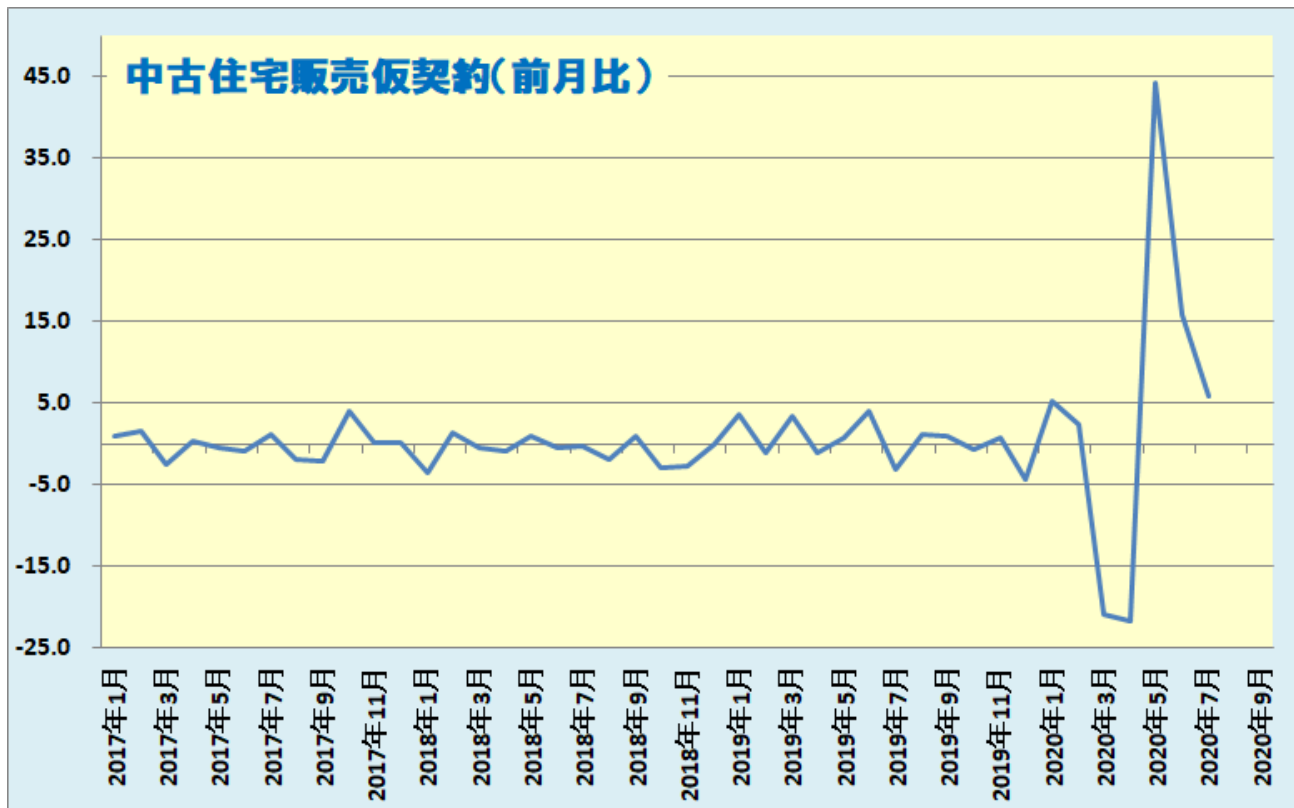


データを基に SBILM が作成

7月中古住宅販売仮契約（前月比） 5.9%（予想 2.0%・前回 16.6%⇒15.8%）

7月中古住宅販売仮契約（前年比） 15.4%（予想 10.8%・前回 12.7%⇒11.8%）

7月の米中古住宅仮契約は、市場予想を上回る伸び幅となり、指数ベースでは122.1と2005年11月以来の高水準となった。地域別では、北東部が+25.2%（前月+45.1%）、西部は+6.8%（+11.7%）、中西部は+3.3%（+12.2%）、南部が+0.9%（+12.3%）。



データを基に SBILM が作成

ジャクソンホールでのパウエル FRB 議長の講演での主な発言

- ・インフレ率は平均で 2%を目指す
- ・平均物価目標を導入、目標を上回ることも容認する
- ・FRB は 5 年ごとに政策を見直す
- ・インフレ率の継続的な低下は、克服が困難
- ・インフレ圧力が強まったら FRB は行動を躊躇しない
- ・インフレがなければ、力強い雇用市場は抑制される
- ・低インフレは経済に深刻なリスクの可能性
- ・米国経済の潜在性は低下

ダウ平均は続伸、ナスダックは6営業日ぶり反落

米株式市場では、パウエルFRB議長がジャクソンホールでの講演で、インフレ目標の枠組みを柔軟化すると表明したことが好感され、米金融緩和長期化への期待感から主要株価指数は堅調な動きとなった。ただ、上昇が続いていたナスダックは、序盤に最高値を更新したものの、その後の利益確定の動きに押されて反落となった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前日比302ドル高まで上昇した。ただ、終盤には上げ幅を縮小し、160ドル高(+0.57%)で終了した。一方、ハイテク株中心のナスダックは、序盤から堅調な動きとなり、一時取引時間中の最高値を更新した。しかし、その後は売りに押されて39ポイント安(-0.34%)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	金融	1.88%	1	ウォルマート	4.54%
2	資本財	0.77%	2	JPモルガン・チェース	3.29%
3	ヘルスケア	0.62%	3	トラベラーズ	3.21%
4	消費者サービス	0.41%	4	アメリカンエキスプレス	3.18%
	素材	-0.39%	5	マイクロソフト	2.46%

データを基にSBILMが作成

ドル/円は序盤下落も、その後 8/14 以来の高値まで上昇

NY 市場では、序盤に GDP 改定値、新規失業保険申請件数など主要な米経済指標が発表されたものの、パウエル FRB 議長の講演を控えて様子見ムードが強まっており、反応は限定的だった。その後、パウエル FRB 議長がジャクソンホールでの講演で、インフレ率が一時的に 2%を超えることを容認する新たな金融政策方針を示したことを受けて、金融緩和策の長期化懸念からドルは主要通貨に対して軟調な動きとなった。さらに、米長期金利が低下したことも加わり、ドル/円は一時 105.61 まで下落した。しかし、物価の上昇よりも、米国の完全雇用の回復を重視している姿勢が示されたこともあり、その後は 0.647% まで低下した長期金利の指標となる米 10 年債利回りが 0.753% まで急反発となったことから、ドルは主要通貨に対して買い戻しが優勢となり、ドル/円は 106.70 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ご自身でお願いします。