

NYマーケットレポート (2022年7月27日)

2022年7月27日 (水)

アジア主要株価指数	終値	前日比	年初来%	外国為替	終値	高値	安値
日経平均	27,715.75	+60.54	-3.74%	USD/JPY	136.49	137.45	136.32
ハンセン指数	20,670.04	-235.84	-11.66%	EUR/JPY	139.17	139.51	138.44
上海総合	3,275.76	-1.68	-10.00%	GBP/JPY	165.87	166.34	164.66
韓国総合	2,415.53	+2.57	-18.88%	AUD/JPY	95.44	95.69	94.75
豪ASX200	6,823.23	+15.96	-8.35%	EUR/USD	1.0196	1.0220	1.0097
シンガポールST	3,205.14	+13.02	2.61%	BRL/JPY	25.905	25.921	25.365
インドSENSEX	55,816.32	+547.83	-4.18%	RUB/JPY	2.193	2.230	2.192

欧州主要株価指数	終値	前日比	年初来%	Commodity	終値	前日比	年初来%
英FT100	7,348.23	+41.95	-0.49%	NY GOLD	1,719.10	+1.40	-5.99%
仏CAC40	6,257.94	+46.49	-12.51%	NY 原油	97.26	+2.28	29.32%
独DAX	13,166.38	+69.45	-17.11%	CBOTコーン	603.00	+2.25	1.64%
スペインIBX35	8,124.40	+54.80	-6.76%	CRB指数	289.083	+2.584	24.40%
イタリアFTSE MIB	21,480.70	+320.72	-21.45%	ドル指数先物	106.452	-0.737	11.27%
トルコ・イスタンブール100	2,544.12	+7.00	36.95%	VIX指数	23.24	-1.45	34.96%
ロシアRTS	1,153.95	+17.93	-27.69%				
南ア全株指数	68,424.97	+3.17	-7.17%				

米主要株価指数	終値	前日比	年初来%	Crypto Currency	本日	前日
米ダウ平均	32,197.59	+436.05	-11.39%	CME Bitcoin(先物・期近)	22850	21005
S&P500	4,023.61	+102.56	-15.58%	XRP(Ripple)【BSTP】	0.354	0.332
NASDAQ	12,032.42	+469.85	-23.09%	Ethereum【BSTP】	1600.60	1378.66
南北米主要株価指数				Bitcoin Cash	124.86	116.50
カナダ・トロント総合	19,254.56	+281.88	-9.27%			
メキシコ・ボルサ指数	46,842.92	+168.62	-12.07%			
ブラジル・ボベスパ指数	101,437.96	+1666.27	-3.23%			

7/28 経済指標スケジュール

- 10:00 【ニュージーランド】7月ANZ企業景況感
- 10:30 【オーストラリア】6月小売売上高
- 10:30 【オーストラリア】2Q輸入物価指数
- 15:00 【ノルウェー】5月失業率
- 15:45 【フランス】6月生産者物価指数
- 16:00 【トルコ】7月経済信頼感
- 18:00 【欧州】7月消費者信頼感
- 18:00 【欧州】7月サービス業信頼感
- 18:00 【欧州】7月経済信頼感
- 18:00 【欧州】7月鉱工業信頼感
- 18:30 【南アフリカ】6月生産者物価指数
- 20:00 【メキシコ】6月失業率
- 21:00 【ドイツ】7月消費者物価指数
- 21:30 【米国】2Q GDP
- 21:30 【米国】2Q個人消費
- 21:30 【米国】新規失業保険申請件数
- 21:30 【米国】失業保険継続受給者数
- 23:30 【米国】EIA天然ガス貯蔵量
- 00:00 【米国】7月カンザスシティ連銀製造業活動指数

オセアニア国債利回り	本日	前日
オーストラリア10年債	3.255%	3.347%
ニュージーランド10年債	3.527%	3.630%
日本国債利回り		
2年債	-0.075%	-0.073%
10年債	0.200%	0.211%
30年債	1.168%	1.185%

欧州国債利回り	本日	前日
ドイツ10年債	0.946%	0.925%
英国 10年債	1.961%	1.917%
フランス 10年債	1.540%	1.520%
イタリア 10年債	3.330%	3.250%
スペイン 10年債	2.140%	2.110%
米国債利回り		
2年債	2.998%	3.053%
10年債	2.785%	2.807%
30年債	3.065%	3.027%

7/28 主要会議・講演・その他予定

- ・米7年債入札
- 米第2四半期決算〜アップル、アマゾン、インテル、メルク、ハネウェル、メルク、ファイザー、その他

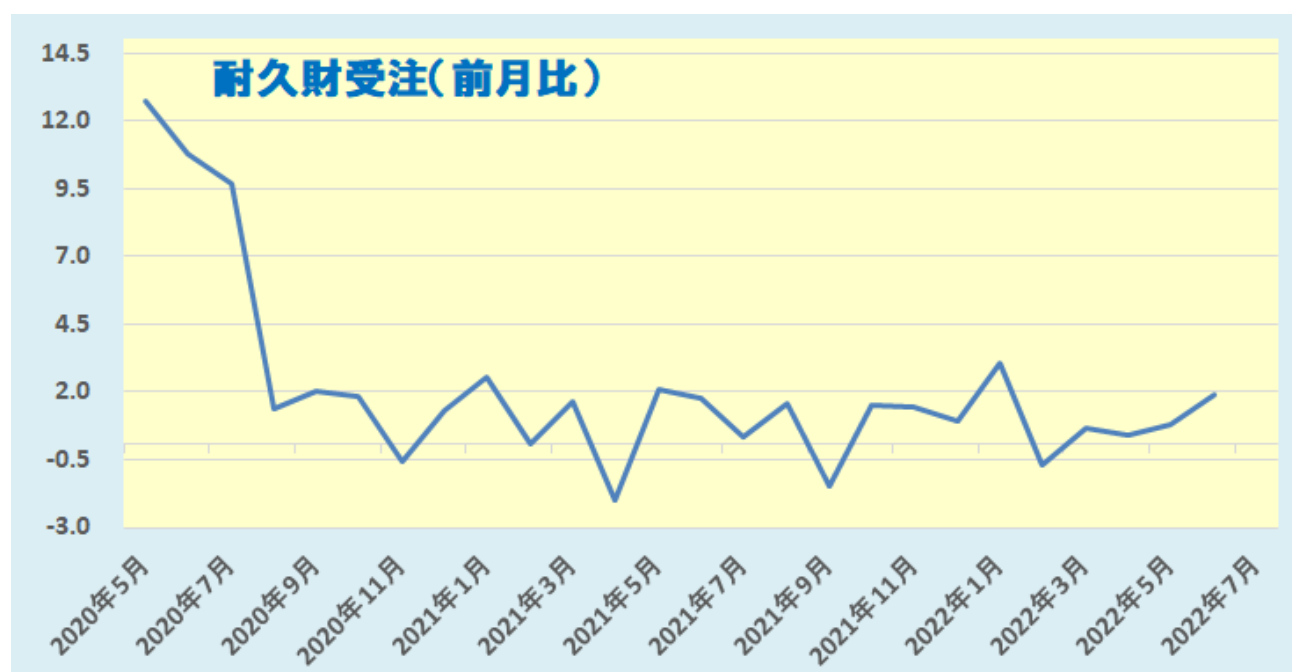
NY 市場レポート（前日 21 時 00 分～午前 5 時 30 分まで）

米国の主要な経済指標の結果

6 月耐久財受注（前月比） 1.9%（予想 -0.3%・前回 0.8%）

6 月耐久財受注[除輸送用機器]（前月比） 0.3%（予想 0.2%・前回 0.7%⇒0.5%）

6 月の米耐久財受注は、市場予想に反して 4 ヶ月連続の伸びとなった。輸送機器は+5.1%となり、民間航空機が-2.1%、国防関連の航空機が+80.6%、自動車・同部品が+1.5%となった。輸送機器を除いた受注は+0.3%だった。資本財は-0.3%となり、資本財から国防関連を除いた受注は+0.1%、コア受注は+0.5%。国防関連は-2.7%だった。

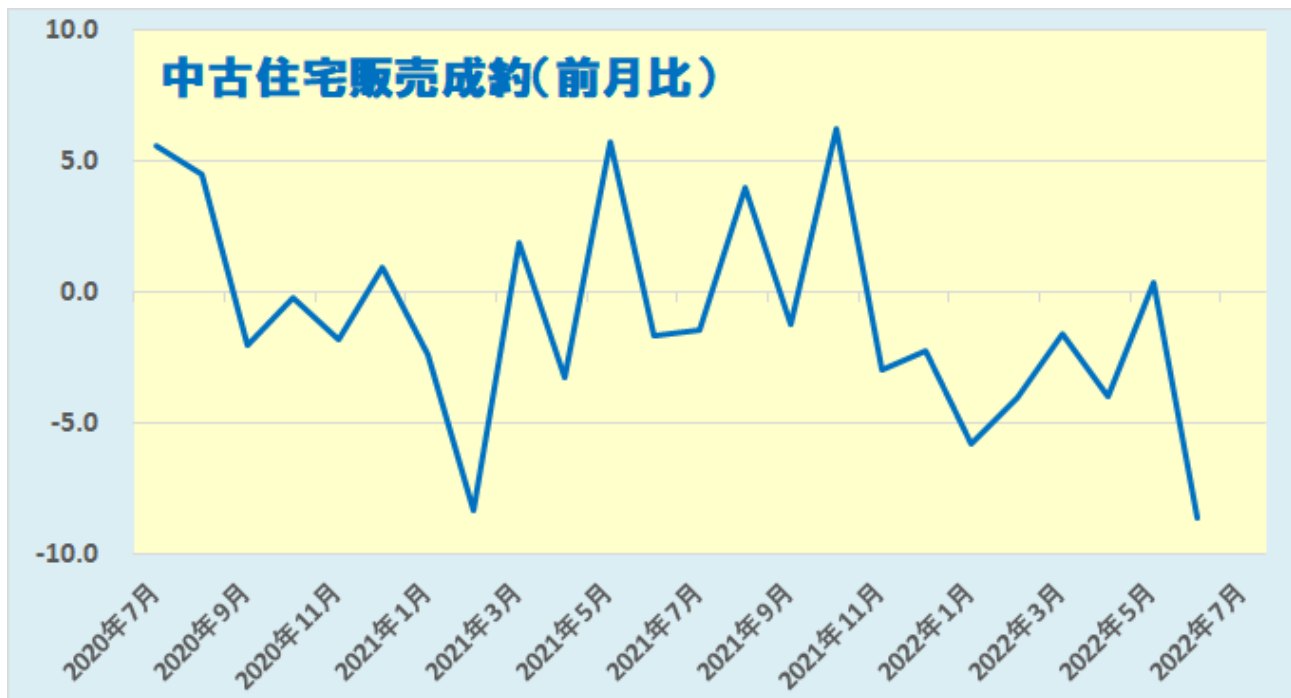


データを基に SBILM が作成

6月中古住宅販売成約（前月比） -8.6%（予想 -1.0%・前回 0.7%⇒0.4%）

6月中古住宅販売成約（前年比） -19.8%（予想 -13.4・前回 -12.0%⇒-12.3%）

6月の米中古住宅仮契約指数は、市場予想を上回るマイナス幅となり、2020年4月以来の低水準となった。地域別では、西部が-15.9%、南部が-8.9%、北東部が-6.7%、中西部が-3.8%となった。住宅ローン金利の上昇が続けば低下が続くとの指摘もあった。



データを基に SBILM が作成

FOMC 政策金利 2.25%-2.50% (予想 2.25%-2.50%・前回 1.50%-1.75%)

FRB は、FOMC で主要政策金利の誘導目標を 0.75%引き上げて 2.25%-2.50%とすることを決定した。2 会合連続で 0.75%の利上げとなった。9 月以降も利上げが続くと見られているが、利上げ幅は縮小すると見られている。

FOMC 主な声明

- ・ FF 金利誘導目標を 0.75%引き上げ 2.25-2.50%に
- ・ 0.75%の利上げは全会一致
- ・ インフレリスクに高い注意を払う
- ・ 支出と生産は軟化したが雇用は力強く伸びている

パウエル FRB 議長の会見での主な発言

- ・ いずれ利上げペース落とすのが適切になる可能性高い
- ・ 異例の大幅利上げを繰り返すかはデータ次第
- ・ 会合ごとに新たに判断すべき時期に来ていると思う
- ・ FOMC は来年の利上げを予想は 9 月に情報更新

- ・ 物価の安定回復で失敗という選択肢はない
- ・ 米経済が今リセッションに入っているとは考えない
- ・ 食品、消費が実際に減少していることを非常に憂慮

米主要株価指数は大幅反発

米株式市場は、前日に発表されたマイクロソフトの決算が好感され、主要株価指数は序盤から底固い動きが続いた。FOMC後のパウエルFRB議長の会見で、景気後退が否定されたことや、大幅利上げ観測が後退との見方が広がったことから、終盤に上げ幅を拡大した。ダウ平均株価は、序盤から小動きの展開が続いたが、FRB議長の会見を受けて上げ幅を拡大し、一時前日比574ドル高まで上昇した。引けにかけて上げ幅を縮小し、436.05ドル高(+1.37%)で終了した。一方、ハイテク株中心のナスダックは、469.85ポイント高(+4.06%)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	テクノロジー	4.61%	1	マイクロソフト	6.69%
2	素材	1.83%	2	セールスフォース	5.77%
3	エネルギー	1.32%	3	ウォルマート	3.78%
4	消費者サービス	1.25%	4	ウォルトディズニー	3.73%
5	金融	1.00%	5	アップル	3.42%

データを基に SBILM が作成

ドルは主要通貨に対して下落

NY 市場では、FOMC の結果発表を控えて、大幅利上げへの期待感からドル買いが先行し、ドルは主要通貨に対して堅調な動きとなった。日米の金融政策の違いが意識されてドル買い・円売りが優勢となり、ドル/円は序盤の 136.75 から 137.43 まで上昇した。さらに、序盤に発表された 6 月米耐久財受注が市場予想に反して大幅な伸びとなったこともドルの押し上げ要因となった。上昇一服後は上値の重い動きとなり、FOMC では市場の予想通り 0.75% の利上げが決定されたものの、反応は限定的だった。さらに、FOMC 後の会見で、パウエル FRB 議長がインフレ抑制のために取り組むとしたことで利上げ継続期待が高まり、ドル買いに反応した。しかし、経済の軟化傾向が指摘されたことや、いずれ利上げペース落とすのが適切との見方を示したことから、大幅利上げへの期待が後退、政策金利の動向に敏感な 2 年債利回りが 3.085% から 2.955% まで低下したことを受けて、ドルは下げ幅を拡大した。一方、欧州通貨や資源国通貨は、対ドルで上昇したことから、対円でも堅調な動きが続いた。



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。