

NYマーケットレポート (2023年7月28日)

2023年7月28日 (金)

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	32,759.23	-131.93	25.54%	USD/JPY	141.13	141.18	138.07
ハンセン指数	19,916.56	+277.45	0.68%	EUR/JPY	155.54	155.61	151.42
上海総合	3,275.93	+59.26	6.04%	GBP/JPY	181.40	181.49	176.34
韓国総合	2,608.32	+4.51	16.63%	AUD/JPY	93.88	84.23	91.81
豪ASX200	7,403.65	-52.27	5.19%	EUR/USD	1.1021	1.1048	1.0944
シンガポールST	3,371.17	33.75	3.69%	BRL/JPY	29.703	29.723	28.926
インドSENSEX	66,160.19	-106.63	8.74%	RUB/JPY	1.491	1.495	1.481

欧州主要株価指数	終値	前日比	年初来%
英FT100	7,694.27	+1.51	3.25%
仏CAC40	7,476.47	+11.23	15.49%
独DAX	16,469.75	+63.72	18.29%
スペインIBX35	9,685.10	-9.60	17.69%
イタリアFTSE MIB	29,500.20	-97.61	24.44%
トルコ・イスタンブール100	7,067.28	+211.17	28.28%
ロシアRTS	1,033.67	-5.37	6.50%
南ア全株指数	78,506.88	239.63	7.47%

Commodity	終値	前日比	年初来%
NY GOLD	1,999.90	+14.70	9.51%
NY 原油	80.58	+0.49	0.40%
CBOTコーン	531.00	-11.25	-21.74%
CRB指数	280.480	+0.31	0.98%
ドル指数先物	101.700	-0.07	-1.73%
VIX指数	13.33	-1.08	-38.49%

米主要株価指数	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	35,459.29	+176.57	6.98%
S&P500	4,582.23	+44.82	19.34%
NASDAQ	14,316.66	+266.55	36.79%

南北米主要株価指数	終値	前日比	年初来%
カナダ・トロント総合	20,519.37	+133.90	5.85%
メキシコ・ボルサ指数	54,910.93	+157.54	13.30%
ブラジル・ボベスパ指数	120,187.11	+197.47	9.53%

Crypto Currency	本日	前日
CME Bitcoin(先物・期近)	29590	29135
XRP(Ripple) [BSTP]	0.711	0.712
Ethereum [BSTP]	1,876.69	1858.53
Bitcoin Cash	242.40	242.87

オセアニア国債利回り	本日	前日
オーストラリア10年債	4.066%	3.922%
ニュージーランド10年債	4.713%	4.625%

日本国債利回り	2年債	10年債	30年債
2年債	-0.010%	-0.043%	
10年債		0.556%	0.450%
30年債			1.369%

7/31 経済指標スケジュール

- 08:50 【日本】6月小売販売額
- 08:50 【日本】6月百貨店・スーパー販売額
- 08:50 【日本】6月鉱工業生産
- 10:00 【ニュージーランド】7月ANZ企業景況感
- 10:30 【中国】7月製造業PMI・非製造業PMI
- 10:30 【オーストラリア】6月民間部門信用
- 11:00 【シンガポール】6月マネーサプライM2
- 14:00 【日本】7月消費者態度指数
- 14:00 【日本】6月住宅着工戸数
- 14:00 【日本】6月建設工事受注
- 15:00 【南アフリカ】6月マネーサプライM3
- 15:30 【スイス】6月実質小売売上高
- 15:45 【フランス】6月消費者支出
- 17:00 【ドイツ】2Q GDP
- 17:30 【香港】2Q GDP
- 17:30 【英国】6月マネーサプライM4
- 17:30 【英国】6月住宅ローン承認件数
- 17:30 【英国】6月マネーサプライM4
- 17:30 【英国】6月住宅証券融資高
- 17:30 【英国】6月消費者信用残高
- 18:00 【欧州】2Q GDP
- 18:00 【欧州】7月消費者物価指数
- 21:00 【南アフリカ】6月貿易収支
- 22:45 【米国】7月シカゴ購買部協会景気指数
- 23:30 【米国】7月ダラス連鎖製造業活動指数

欧州国債利回り	本日	前日
ドイツ10年債	2.489%	2.474%
英国 10年債	4.316%	4.310%
フランス 10年債	3.027%	3.000%
イタリア 10年債	4.104%	4.070%
スペイン 10年債	3.506%	3.480%

米国債利回り	2年債	10年債	30年債
2年債	4.885%	4.928%	
10年債		3.957%	3.998%
30年債			4.013%

7/31 主要会議・講演・その他予定

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

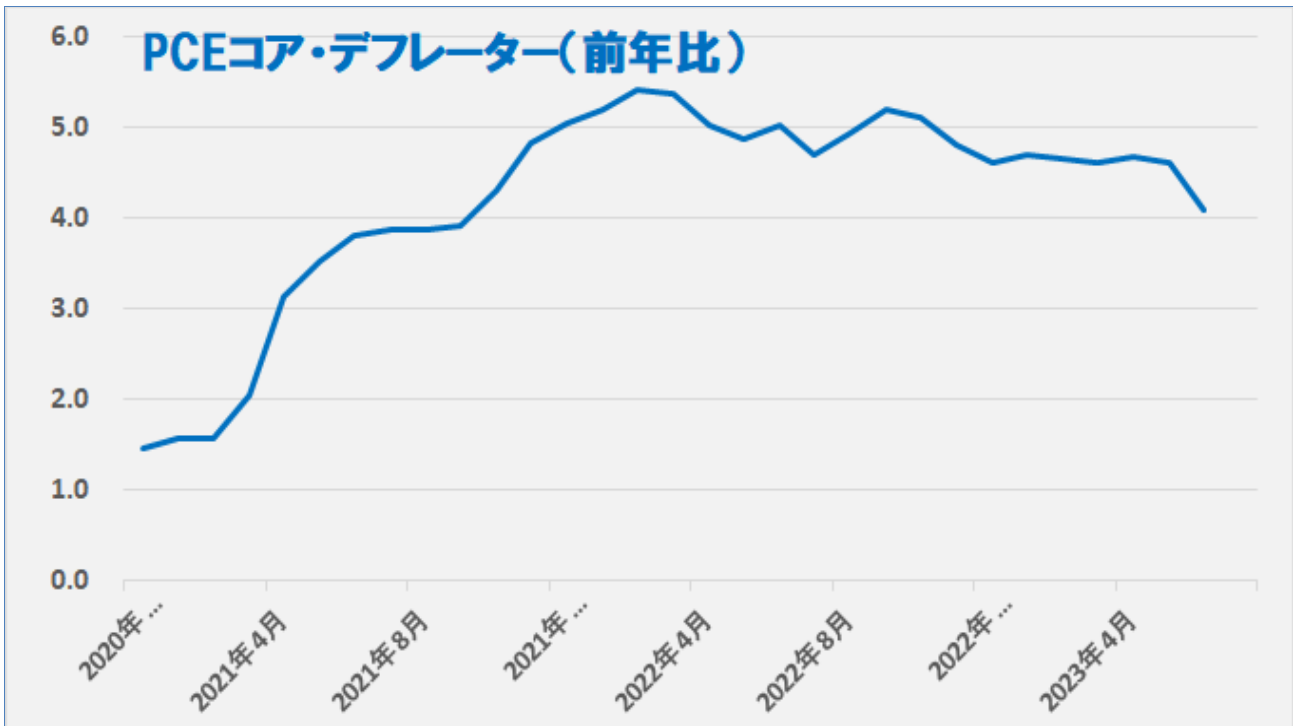
6 月個人所得（前月比）0.3%（予想 0.5%・前回 0.4%）

6 月個人支出（前月比）0.5%（予想 0.4%・前回 0.1%）

6 月 PCE デフレーター（前年比）3.0%（予想 3.0%・前回 3.8%）

6 月 PCE コア・デフレーター（前年比）4.1%（予想 4.2%・前回 4.6%）

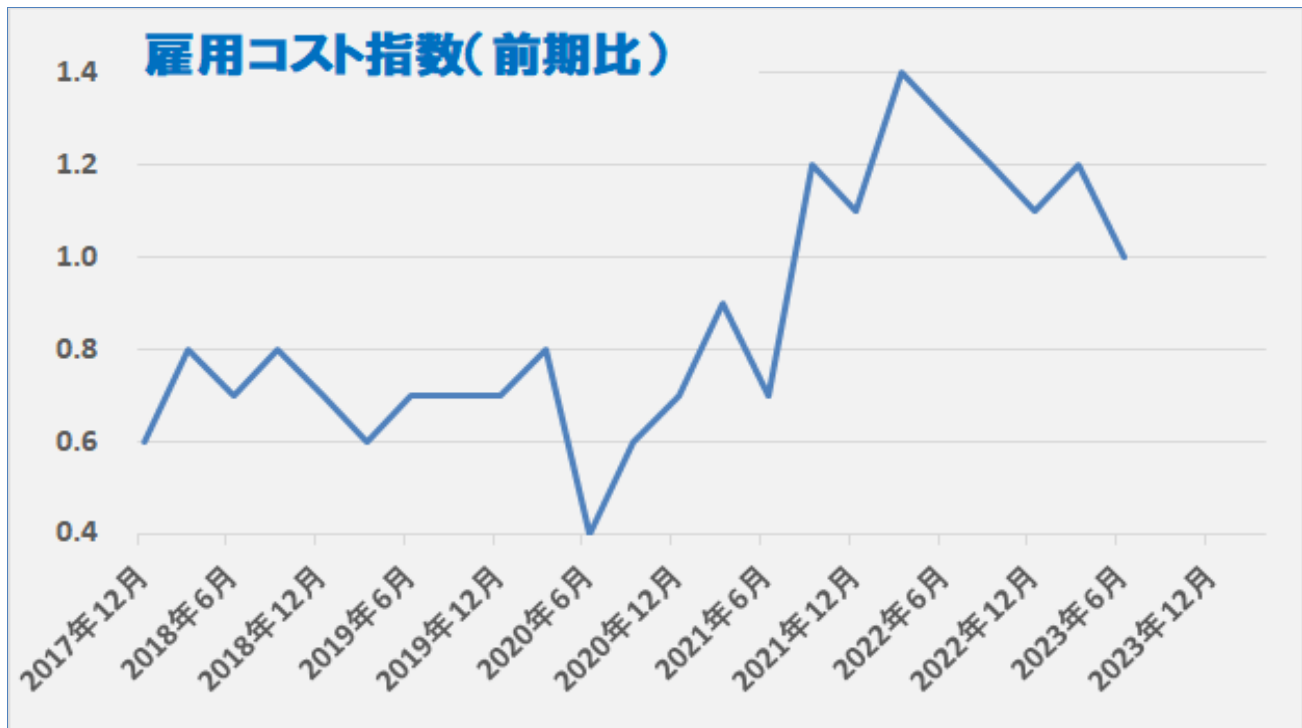
6 月の米個人所得・支出統計では、個人所得が市場予想を下回ったものの、個人支出は市場予想を上回る結果となった。また PCE デフレーターは 2021 年 3 月以来、2 年 3 カ月ぶりの低水準となり、コア指数上昇率も 2021 年 9 月以来の低水準となった。ただ、FRB が目標とする 2%を引き続き上回っている。



データを基に SBILM が作成

2Q 雇用コスト指数（前期比）1.0%（予想 1.1%・前回 1.2%）

4-6 月期の米雇用コスト指数は、市場予想を下回り、2 年ぶりの低水準に鈍化した。労働市場が緩やかに減速している兆候が示された。賃金・給与の伸びは広範囲で減速し、諸手当の伸びも緩やかになった。また、非軍人労働者の賃金・給与は、前年同期比+4.6%となり、2021 年末以来の水準に鈍化した。



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 71.6 (予想 72.6・前回 72.6)

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1.0ポイント低下し、市場予想を下回った。ただ、前月比では7.2ポイント上昇となり、2021年10月以来、1年9ヵ月ぶりの高水準となった。現状指数は76.6で速報値から0.9ポイント低下、前月から7.6ポイント上昇。先行指数は68.3で速報値が1.1ポイント低下、前月から6.8ポイント上昇。一方、1年後のインフレ期待は3.4%で速報値から変わらず、前月から0.1ポイント上昇した。



データを基に SBILM が作成

米主要株価指数は反発

米株式市場では、序盤に発表された米 PEC デフレーターや雇用コスト指数が予想より低下したことから、FRBの利上げサイクルが終了するとの観測が高まり、主要株価指数は序盤から堅調な動きとなった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前日比 282 ドル高まで上昇した。その後、上げ幅を縮小し、176.57 ドル高 (+0.50%) で終了。一方、ハイテク株中心のナスダックは、266.55 ポイント高 (1.90%) 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	1.45%	1	インテル	6.60%
2	消費財	1.43%	2	P&G	2.83%
3	素材	0.95%	3	マイクロソフト	2.31%
4	資本財	0.81%	4	ボーイング	2.11%
5	消費者サービス	0.25%	5	ベライゾン	1.43%

データを基に SBILM が作成

ドル円・クロス円は堅調な動き

NY 市場では、FRB が政策判断で重視する PEC デフレーターが大幅に低下してインフレ懸念和らぐ中、米主要株価指数が堅調な動きとなり、リスク志向の動きからドル円・クロス円は堅調な動きとなった。その後に発表されたミシガン大消費者信頼感指数が、速報から低下したことから上値の重い動きが見られたものの、前月から大幅な改善が維持されたことから下値は限定的となり、ドル円・クロス円は終盤まで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自身でお願いします。