

NY マーケットレポート (2024 年 6 月 6 日)

2024年 6月6日 (木)

アジア主要株価指数	終値	前日比	年初来%
日経平均	38,703.51	+213.34	15.66%
ハンセン指数	18,476.80	+51.84	8.38%
上海総合	3,048.79	-16.61	2.48%
韓国総合	2,689.50	+27.40	1.29%
豪ASX200	7,821.77	+52.77	3.04%
シンガポールST	3,330.81	+0.80	2.79%
インドSENSEX	75,074.51	+692.27	3.92%

外国為替	終値	高値	安値
USD/JPY	155.62	156.45	155.36
EUR/JPY	169.50	170.29	169.21
GBP/JPY	199.10	199.94	198.84
AUD/JPY	103.74	103.98	103.62
EUR/USD	1.0892	1.0902	1.0862
BRL/JPY	29.537	29.614	29.187
RUB/JPY	1.709	1.719	1.701

欧州主要株価指数	終値	前日比	年初来%
英FT100	8,285.34	+38.39	7.14%
仏CAC40	8,040.12	+33.55	6.59%
独DAX	18,652.67	+76.73	11.35%
スペインIBX35	11,444.00	+90.90	13.28%
イタリアFTSE MIB	34,834.30	+326.46	14.77%
トルコ・イスタンブール100	10,279.69	-71.27	37.61%
ロシアRTS	1,131.97	-8.32	4.48%
南ア全株指数	77,123.64	+294.51	0.30%

Commodity	終値	前日比	年初来%
NY GOLD	2,390.90	+15.40	14.28%
NY 原油	75.55	+1.48	5.93%
CBOTコーン	452.00	12.75	-3.98%
CRB指数	292.420	+4.710	10.84%
ドル指数先物	104.102	-0.166	2.70%
VIX指数	12.58	-0.05	1.04%

米主要株価指数	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	38,886.17	+78.84	3.17%
S&P500	5,352.96	-1.07	12.23%
NASDAQ	17,173.12	-14.78	14.40%

Crypto Currency	終値	前日
CME Bitcoin (先物・期近)	71135	71845
XRP (Ripple) [BSTP]	0.521	0.527
Ethereum [BSTP]	3799.45	3864.31
Bitcoin Cash	493.85	493.64

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	22,229.10	+84.08	6.06%
メキシコ・ボルサ指数	54,477.25	+66.74	-5.07%
ブラジル・ボベスパ指数	122,898.80	+1491.47	-8.41%

オセアニア国債利回り	終値	前日
オーストラリア10年債	4.223%	4.242%
ニュージーランド10年債	4.625%	4.659%
日本国債利回り		
2年債	0.342%	0.364%
10年債	0.964%	1.017%
30年債	2.091%	2.191%

6/7 経済指標スケジュール	
08:30	【日本】4月家計調査消費支出
11:30	【中国】5月貿易収支 (時間不確定)
14:00	【日本】4月景気一致CI指数
14:00	【日本】4月景気先行CI指数
15:00	【英国】5月ハリファックス住宅価格
15:00	【南アフリカ】5月外貨準備高
15:00	【ドイツ】4月鉱工業生産
15:00	【ドイツ】4月貿易収支
15:45	【フランス】4月経常収支
15:45	【フランス】4月貿易収支
18:00	【欧州】1Q雇用者数
18:00	【欧州】1Q GDP
21:30	【米国】5月失業率
21:30	【米国】5月非農業部門雇用者数
21:30	【米国】5月平均時給
21:30	【カナダ】5月失業率
21:30	【カナダ】5月雇用ネット変化率
23:00	【米国】4月卸売在庫
23:00	【米国】4月卸売売上高
04:00	【米国】4月消費者信用残高

欧州国債利回り	終値	前日
英国 10年債	4.172%	4.183%
フランス 10年債	3.028%	2.985%
ドイツ 10年債	2.547%	2.510%
イタリア 10年債	3.864%	3.817%
スペイン 10年債	3.276%	3.237%
米国債利回り		
2年債	4.724%	4.722%
10年債	4.287%	4.275%
30年債	4.435%	4.430%

6/7 主要会議・講演・その他予定
・ドイツ連銀総裁 講演
・クックFRB理事 講演

NY 市場レポート（前日 21 時 00 分～午前 5 時 30 分まで）

欧州の主要な経済指標の結果

欧州中銀 政策金利 4.25%（予想 4.25%・前回 4.50%）

下限政策金利[中銀預金金利] 3.75%（予想 3.75%・前回 4.00%）

上限政策金利[限界貸出金利] 4.50%（予想 4.50%・前回 4.75%）

ECB 声明

- ・ 2024 年の経済成長率は 0.9%と予想
- ・ 今年と来年の総合インフレ率とコアインフレ率の最新のユーロ圏スタッフ予測は上方修正
- ・ PEPP は 2024 年 6 月末まで全額再投資する
- ・ インフレ目標を達成するために必要な期間は政策金利を十分に制限的な水準に維持
- ・ 下半期は平均で毎月 7 億 5000 万ユーロのペースで PEPP ポートフォリオを削減

ラガルド ECB 総裁 会見

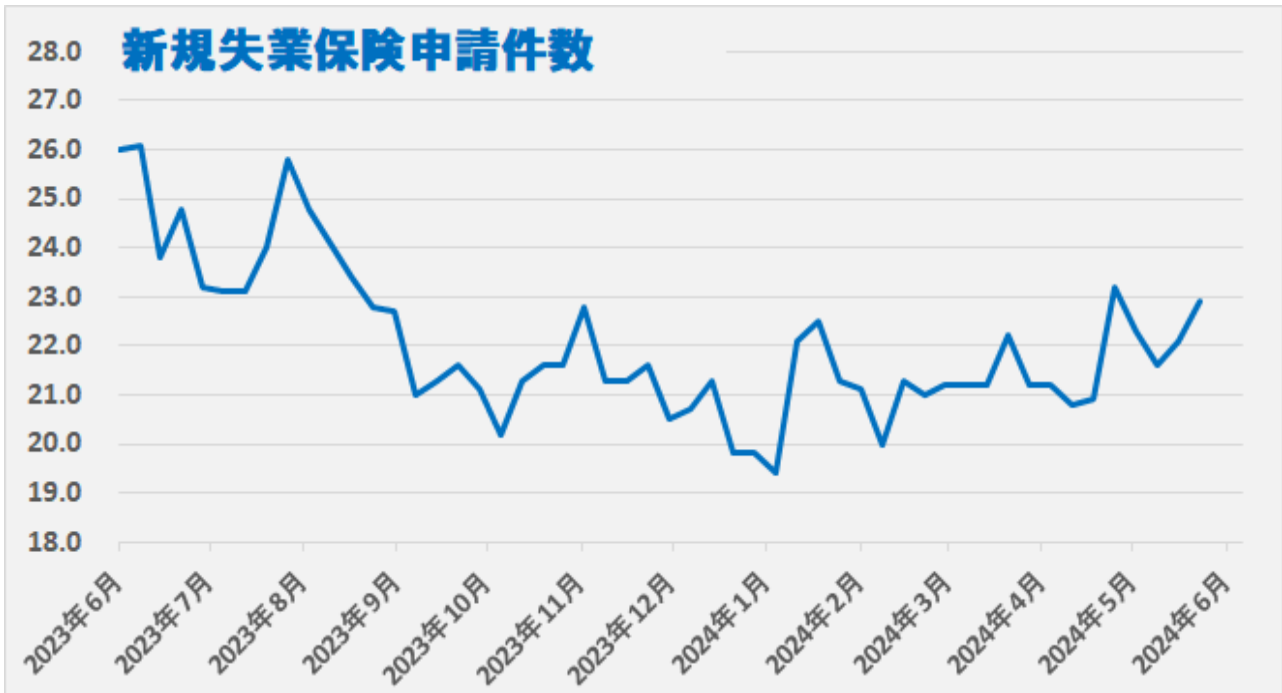
- ・ 経済は回復を継続へ
- ・ 賃金上昇はハイペース
- ・ インフレ率は来年下期に 2%に向けて低下へ
- ・ ECB は巻き戻しに動いているとは言わない
- ・ スピードとタイミングはデータが決定する
- ・ ECB 決定は 1 人を除く全員が一致
- ・ ECB は経済予測の会合だけでなく全会合で決定可能
- ・ 中立金利には近くない

米国の主要な経済指標の結果

新規失業保険申請件数 22.9 万件（予想 22.0 万件・前回 21.9 万件⇒22.1 万件）

失業保険継続受給者数 179.2 万人（予想 179.0 万人・前回 179.1 万人⇒179.0 万人）

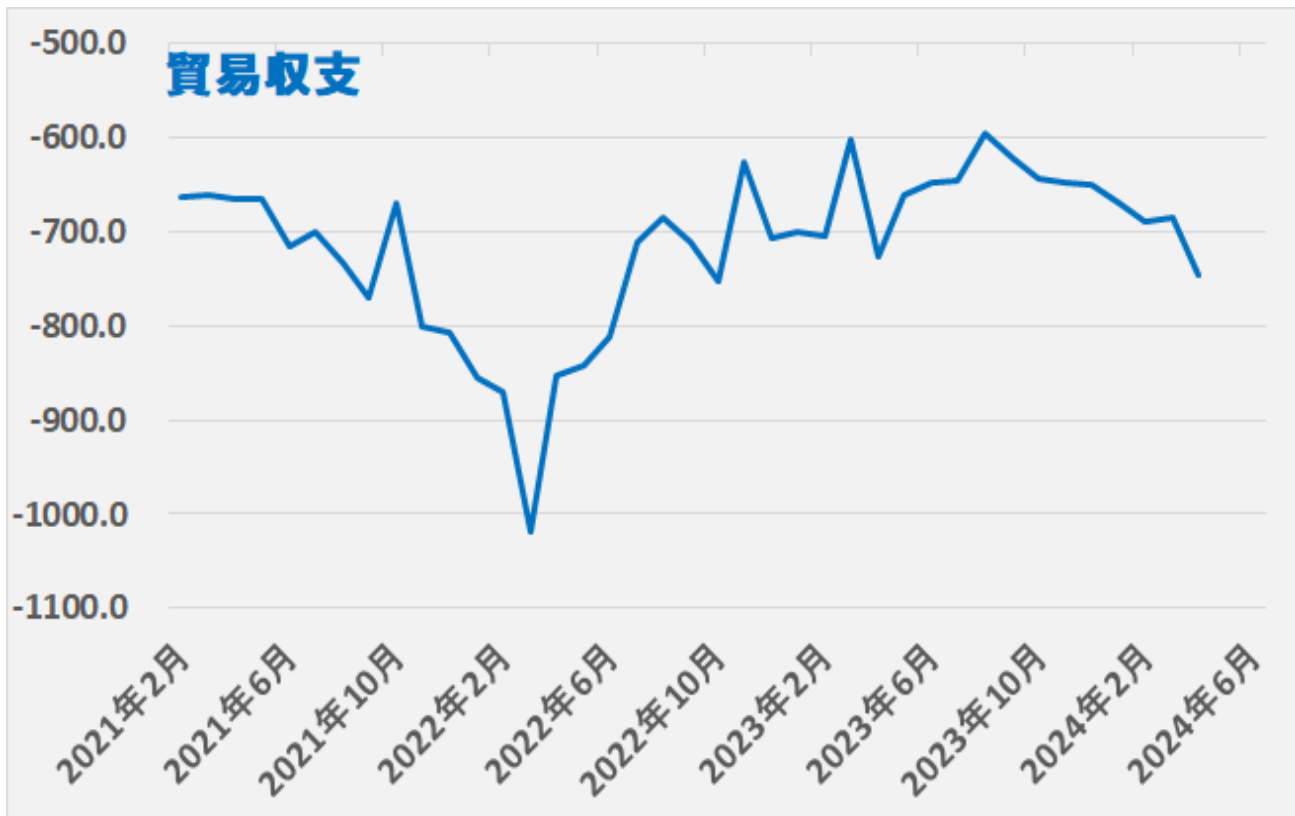
新規失業保険申請件数（6/1 までの週）は、市場予想を上回り、2 週連続の増加となった。一方、失業保険継続受給者数（5/25 までの週）は市場予想を上回り、5 週連続の増加で直近の労働市場の鈍化傾向が示された。



データを基に SBILM が作成

4月貿易収支 -746億USD (予想 -764億USD・前回 -694億USD⇒-686億USD)

4月の米貿易収支では、赤字額が市場予想を下回ったものの、前回からは拡大となり2022年10月以来の大きさとなった。自動車やコンピューターなど財の輸入が急増したことが影響した。輸入額は+2.4%と2022年半ば以来の高水準となり、輸出額は+0.8%にとどまった。また、1-3月期GDPで、純輸出は2022年第1四半期以来のマイナス寄与となった。



データを基に SBILM が作成

1Q 非農業部門労働生産性（前期比年率）0.2%（予想 0.0%・前回 0.3%）

1Q 単位労働費用（前期比年率）4.0%（予想 4.9%・前回 4.7%）

1-3 月期の米非農業部門の労働生産性指数は、速報値から下方修正され、単位労働コストも速報値から大幅に下方修正された。生産と労働時間の下方修正が影響し、活動減速が示された。



データを基に SBILM が作成

ダウ平均は3営業日続伸、ナスダックは4営業日ぶりに反落

米株式市場では、FRBの利下げ開始期待を背景に、主要株価指数は序盤から堅調な動きとなった。ただ、前日に続き雇用関連の指標が冴えない結果となったこともあり、上値の重い動きとなった。また、前日に史上最高値を更新したナスダックは利益確定の売りが出たことや、前日大幅高となった半導体大手株が下落したことが圧迫要因となり、反落となった。ダウ平均は、序盤に前日比196ドル高まで上昇したものの、その後は下落に転じて一時71ドル安まで下落した。ただ、終盤には再び堅調な動きとなり、78.84ドル高(+0.20%)で終了。一方、ハイテク株中心のナスダックは、上昇して始まったものの、その後は下落に転じて上値の重い動きが続き、14.78ポイント安(-0.09%)で終了した。



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	消費財	1.15%	1	セールスフォース	2.63%
2	消費者サービス	0.72%	2	アマゾン	2.05%
3	エネルギー	0.61%	3	ナイキ	1.48%
4	テクノロジー	0.55%	4	P&G	1.46%
5	通信サービス	0.22%	5	ビザ	0.93%

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、序盤に発表された 1-3 月期の米単位労働コストの改定値が予想外に速報値から下方修正されたことや、新規失業保険申請件数も増加したことから、ドルは下振れとなる場面もあった。ただ、下値は限定的となりその後は米金利が上昇したことからドルも反発となった。ドル/円は、序盤の 156.26 から 155.87 まで下落したものの、その後は 156.44 まで上昇した。しかし、終盤にかけて米金利が低下に転じたことから、ドルは主要通貨に対してやや軟調な動きとなり、ドル/円も 155.47 まで下落した。一方、ECB は市場の予想通り政策金利の引き下げを発表したものの、スタッフ予想で今年と来年のインフレ率が上方修正されたこともあり、ユーロ買いに反応する場面もあった。しかし、その後は上値の重い動きが続いた。



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。