SBI Liquidity Market

NY マーケットレポート（2024 年 7 月 31 日）

2024年 7月31日（水）

アジア主要株価指数	終値	前日比	年初来%
日経平均	39,101.82	+575.87	16.85%
ハンセン指数	17,344.60	+341.69	1.74%
上海総合	2,938.75	+59.45	-1.22%
韓国総合	2,770.69	+32.50	4.35%
豪ASX200	8,092.33	+139.16	6.61%
シンガポールST	3,455.94	+14.17	6.66%
インドSENSEX	81,741.34	+285.94	13.15%

外国為替	終値	高値	安値
USD/JPY	150.08	153.90	149.62
EUR/JPY	162.46	166.55	162.02
GBP/JPY	192.97	197.60	192.18
AUD/JPY	98.16	100.16	97.39
NZD/JPY	89.32	90.86	88.69
EUR/USD	1.0824	1.0850	1.0802
BRL/JPY	26.451	27.238	26.318

欧州主要株価指数	終値	前日比	年初来%
英FT100	8,368.00	+93.57	8.21%
仏CAC40	7,531.49	+56.55	-0.15%
独DAX	18,508.65	+97.47	10.49%
スペインIBX35	11,065.00	-137.60	9.53%
イタリアFTSE MIB	33,763.86	-144.16	11.24%
トルコ・イスタンブール100	10,638.58	-53.10	42.41%
南ア全株指数	82,765.12	+1566.48	7.64%

Commodity	終値	前日比	年初来%
NY GOLD	2,473.00	+21.10	18.21%
NY 原油	77.91	+3.18	9.24%
CBOTコーン	399.75	-5.25	-15.08%
CRB指数	278.120	+3.380	5.42%
ドル指数先物	104.096	-0.458	2.70%
VIX指数	16.36	-1.33	31.41%

Crypto Currency	終値	前日
CME Bitcoin（先物・期近）	65075	66740
XRP(Ripple)【BSTP】	0.390	0.626
Ethereum 【BSTP】	3221.46	3281.35
Bitcoin Cash	413.33	432.62

米主要株価指数	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	40,842.79	+99.46	8.37%
S&P500	5,522.30	+85.86	15.78%
NASDAQ	17,599.40	+451.98	17.24%
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	23,110.81	+286.13	10.27%
メキシコ・ボルサ指数	53,093.96	+768.54	-7.48%
ブラジル・ボベスパ指数	127,651.81	+1512.60	-4.87%

オセアニア国債利回り	終値	前日
オーストラリア10年債	4.112%	4.277%
ニュージーランド10年債	4.326%	4.385%
日本国債利回り		
2年債	0.456%	0.382%
10年債	1.056%	1.004%
30年債	2.176%	2.122%

欧州国債利回り	終値	前日
英国 10年債	3.968%	4.042%
フランス 10年債	3.008%	3.048%
ドイツ 10年債	2.299%	2.335%
イタリア 10年債	3.647%	3.694%
スペイン 10年債	3.111%	3.157%
米国債利回り		
2年債	4.257%	4.359%
10年債	4.030%	4.139%
30年債	4.303%	4.395%

8/1 経済指標スケジュール

08：00 【オーストラリア】7月製造業PMI
10：30 【オーストラリア】2Q輸出物価指数
10：30 【オーストラリア】6月貿易収支
10：30 【オーストラリア】2Q輸入物価指数
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
15：00 【ドイツ】7月ネーションワイド住宅価格
16：00 【トルコ】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
17：00 【欧州】8月欧州中銀　経済報告
17：30 【香港】6月小売売上高[価額]
17：30 【英国】7月製造業PMI
18：00 【欧州】6月失業率
20：00 【英国】政策金利
20：00 【英国】政英中銀四半期インフレ報告
20：00 【英国】政英中銀議事録
20：30 【米国】7月チャレンジャー人員削減数
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
21：30 【米国】2Q非農業部門労働生産性
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

8/1 主要会議・講演・その他予定

・ベイリーBOE総裁 会見

米第2四半期決算～モデルナ、リジェネロン、アップル、アマゾン、インテル、スクエア、その他

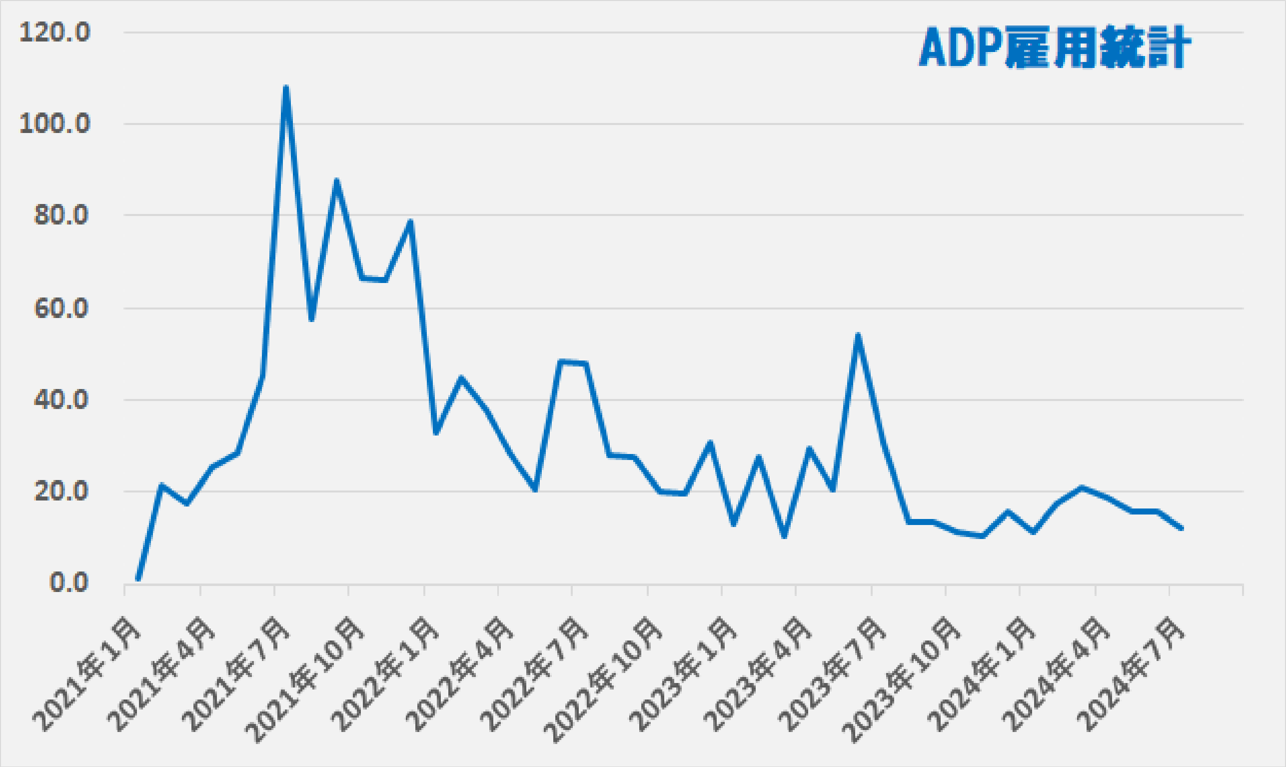
SBILM が作成

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

7月ADP雇用統計　12.2万人（予想　15.0万人・前回　15.0万人⇒15.5万人）

7月の米ADP雇用統計では、雇用者数の伸びが市場予想を下回り、1月以来の低い伸びとなった。労働需要減速の兆候と整合する内容となった。専門職や情報産業、製造業を中心に複数の業種で雇用が減少。人員削減の多くは従業員数が約20-49人の小規模企業に集中している。また、賃金の伸びは転職した人、同じ職にとどまった人いずれも2021年以来の低い伸びとなった。



データを基にSBILMが作成

7 月シカゴ購買部協会景気指数　45.3（予想　45.0・前回　47.4）

7 月のシカゴ購買部協会景況指数は、市場予想を上回ったものの、前月からは低下となった。また、景気の拡大・縮小の判断基準となる 50 を 8 ヵ月連続で下回った。

データを基に SBILM が作成

6 月中古住宅販売仮契約（前月比）　4.8%（予想　1.5%・前回　-2.1%）

6 月中古住宅販売仮契約（前年比）　-7.8%（予想　-7.4%・前回　-2.1%）

6 月の米中古住宅販売仮契約は、前月比で市場予想を上回り、昨年 12 月以来の大幅な伸びとなった。住宅価格と住宅ローン金利の高止まりにもかかわらず、引っ越しや新しい家の需要が増えていることが明らかになった。ただ、前年比ベースでは市場予想を下回り、昨年 9 月以来の低い伸びとなった。

データを基に SBILM が作成

FOMC 政策金利　　5.25%-5.50%（予想　5.25%-5.50%・前回　5.25%-5.50%）

データを基に SBILM が作成

FOMC の主な声明

・最近の指標は経済活動が引き続き堅調なペースで拡大していることを示している

・雇用の伸びは緩やかで失業率は上昇しているが依然低い

・インフレ率はこの 1 年で緩和したが依然としてやや高い水準にある

・利下げにはインフレに関する自信を深めるのを待ちたい

・失業率は上昇してきたがまだ低い

・2 大責務両方面のリスクに留意

・ここ数か月でさらにいくらかの進展があった

・インフレ率を 2%の目標に戻すことに強く取り組む

・金融政策の適切な姿勢を評価するに当たり委員会は今後もたらされる経済見通しに関する情報の意味を引き続き監視する

・もしも委員会の目標の達成を妨げる可能性があるリスクが生じた場合委員会は金融政策の姿勢を適切に調整する準備がある

・今回の金融政策決定は全会一致

パウエル FRB 議長の会見での主な発言

・責務の両サイドのリスクを注視

・インフレ率を 2%の目標に戻すことに強くコミット

・この 2 年で両方の目標で大きな進歩を遂げた

・2 つの責務にしっかりと焦点を当て続ける

・供給条件を改善し堅調な需要を支える

・9 月 FOMC で利下げが選択肢になる可能性ある

・FOMC は利下げに近づいているという感触得ている

・経済が底堅さ維持すれば必要に応じて金利維持へ

・労働市場の著しい冷え込みは望まない

・これから 9 月会合まで多くのことがありそれらを踏まえ判断する

・労働市場の下向きのリスクは現実的になった

・インフレは低下しておりわれわれの目標に近づいている

・0.50%の利下げは現時点で考えているものではない

・9 月利下げの場合は非政治的なものになり得ると確信

・景気に過熱も急減速の兆しもない

・利下げの時期は近づいている 9 月かもしれない

ダウ平均は続伸、ナスダックは反発

米株式市場では、主要株価指数は序盤から底固い動きが続いた。そして、FOMC では政策金利が予想通り据え置きとなったものの、会見でパウエル FRB 議長が 9 月の利下げの可能性に言及したことを受けて買いが優勢となった。上昇一服後は、利益確定の動きも見られ、上げ幅を縮小した。ただ、米長期金利が低下したことも加わり、金利動向に敏感なナスダックは 2.6%超の大幅上昇となった。　ダウ平均は、序盤から底固い動きが続き、一時前日比 455 ドル高まで上昇し、18 日に付けた史上最高値に迫る場面もあった。ただ、その後は利益確定の動きなどに押されて上げ幅を縮小し、99.46 ドル高(+0.24%)で終了。一方、ナスダックは 451.98 ポイント高（2.64%）で終了した。

セクター別変動率(ダウ平均)		
	セクター	変動率
1	資本財	1.05%
2	消費者サービス	0.91%
3	通信サービス	0.90%
4	エネルギー	0.56%
5	テクノロジー	0.12%

個別の変動率(ダウ平均銘柄)		
	銘柄	変動率
1	アマゾン	2.90%
2	インテル	2.02%
3	ボーイング	2.00%
4	アップル	1.50%
5	DOW	1.45%

データを基に SBILM が作成

ドルは主要通貨に対して上値の重い動き

NY 市場では、日銀の追加利上げへの思惑を背景に円買いとなった流れを引き継ぎ、ドル円・クロス円は序盤から上値の重い動きとなった。さらに、米 ADP 雇用統計、雇用コスト指数がともに冴えない結果となったことも加わり、ドルは主要通貨に対して軟調な動きとなった。ドル/円は、序盤の 150.33 から 149.63 まで下落した。その後は、低下していた米長期金利が上昇したことや、FOMC で政策金利が据え置かれたことを受けて、ドル/円は 151.27 まで上昇した。しかし、FRB 議長が「利下げの時期は近づいている、9 月かもしれない」「9 月の FOMC では利下げが選択肢となる可能性がある」との見解が示したこと受けて、米金利低下とともにドルは主要通貨に対して下落となり、ドル/円は 149.62 まで下落して 3/19 以来の安値となった。

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、 複写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。