

NY マーケットレポート (2018年8月1日)

2018年8月1日(水)

アジア主要株価	終値	前日比	年初来%	外国為替	終値	高値	安値
日経平均	22746.70	+192.98	-0.08%	USD/JPY	111.61	112.15	111.40
ハンセン指数	28340.74	-242.27	-5.28%	EUR/JPY	130.13	131.11	130.03
上海総合	2824.53	-51.87	-14.59%	GBP/JPY	146.48	147.15	145.32
韓国総合	2307.07	+11.81	-6.50%	AUD/JPY	82.59	83.13	82.49
豪ASX200	6275.72	-4.48	3.47%	NZD/JPY	75.76	76.31	75.73
インドSENSEX	37521.62	-84.96	10.17%	EUR/USD	1.1660	1.1700	1.1657

欧州主要株価	終値	前日比	年初来%	コモディティ	終値	前日比	年初来%
英FT100	7652.91	-95.85	-0.45%	NY GOLD	1227.60	-6.00	-6.6%
仏CAC40	5498.37	-12.93	3.50%	NY 原油	67.66	-1.10	12.4%
独DAX	12737.05	-68.45	-1.40%	CBOTコーン	379.50	-7.00	4.1%
スペインIBX35	9799.30	-71.40	-2.44%	CRB指数	191.64	-2.889	-1.2%
イタリアFTSE MIB	21791.45	-424.24	-0.28%	ドル指数先物	94.666	+0.112	2.8%
南ア全株指数	57399.53	-32.93	-3.54%	VIX指数	13.15	+0.32	19.1%

米国主要株価	終値	前日比	年初来%	Crypto Currency	本日	前日
米ダウ平均	25333.82	-81.37	2.49%	CBOE Bitcoin(先物・期近)	7470	7680
S&P500	2813.36	-2.93	5.23%	CME Bitcoin(先物・期近)	7465	7685
NASDAQ	7707.29	+35.50	11.46%	Ripple (BSTP)	0.439	0.432
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%	Ethereum (BSTP)	409.58	432.17
トロント総合	16376.77	-57.24	1.03%	Bitcoin Cash	745.82	767.82
ボルサ指数	49449.44	-248.57	0.19%			
ボベスパ指数	79301.65	+81.22	3.80%			

*USD 6:00時点

*一部暫定値

8/2 経済指標スケジュール

08:50	【日本】7月マネタリーベース
08:50	【日本】7月対内外証券投資
10:30	【オーストラリア】6月貿易収支
14:45	【スイス】7月SECO消費者信頼感指数
16:15	【スイス】6月実質小売売上高
16:30	【スイス】7月製造業PMI
17:30	【英国】7月建設業PMI
18:00	【欧州】6月生産者物価指数
20:00	【英国】政策金利発表
20:00	【英国】8月英中銀議事録
20:00	【英国】8月英中銀四半期インフレ報告
20:00	【南アフリカ】6月電力消費・発電
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
22:00	【シンガポール】7月電子産業指数
22:00	【シンガポール】7月購買部景気指数
22:00	【メキシコ】6月景気先行指数
23:00	【米国】6月製造業受注指数
23:00	【米国】6月耐久財受注
23:30	【米国】EIA天然ガス貯蔵量
03:00	【メキシコ】政策金利発表

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.093%	-0.106%
5年債	-0.048%	-0.089%
10年債	0.131%	0.062%
30年債	0.815%	0.759%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.478%	0.443%
英国10年債	1.380%	1.330%
フランス10年債	0.780%	0.730%
米国債利回り		
2年債	2.678%	2.669%
3年債	2.780%	2.766%
5年債	2.875%	2.848%
7年債	2.962%	2.925%
10年債	3.006%	2.960%
30年債	3.132%	3.082%

8/2 主要会議・講演・その他予定

- ・ 雨宮日銀副総裁 講演
- ・ カーニーBOE総裁 会見

NY 市場レポート

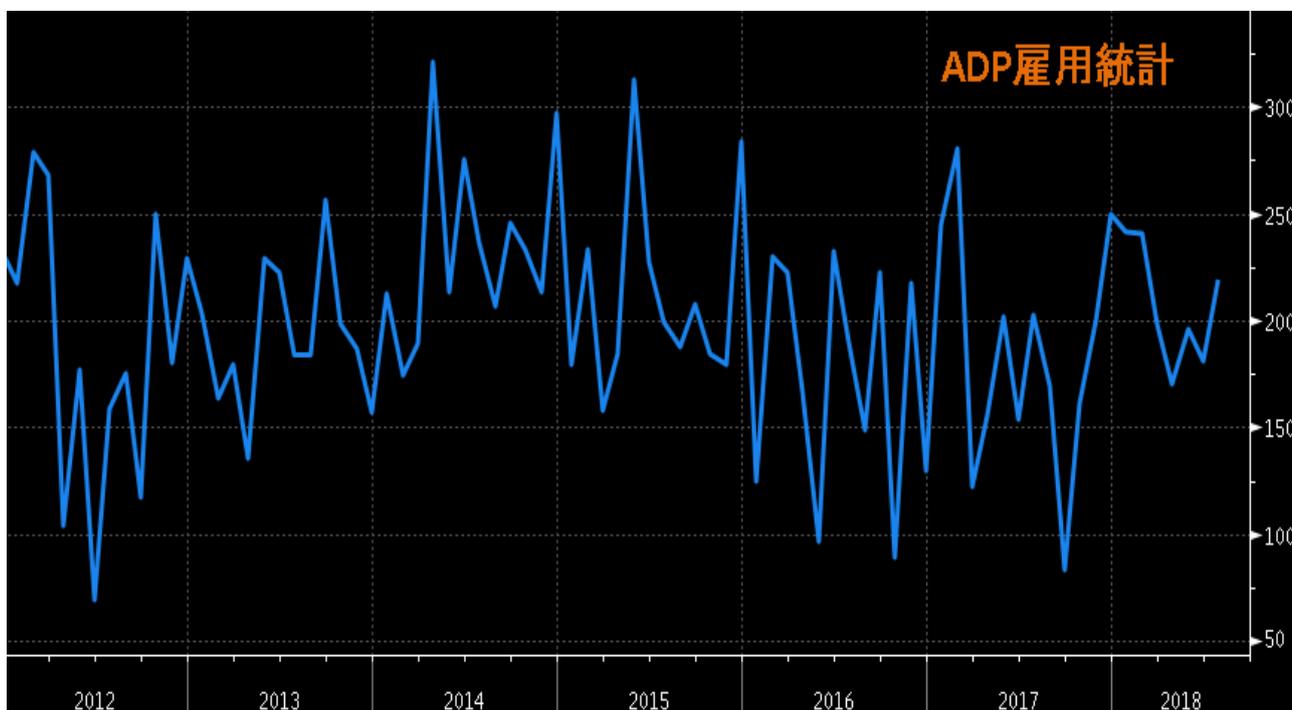
◀ NY 市場概況 ▶

序盤に発表された米 ADP 雇用統計が予想以上の伸びとなったものの、FOMC の結果発表を控えて様子見ムードも強く、反応は限定的となった。その後、ISM 製造業指数が悪化したことや、米国が関税引き上げなら反撃すると中国が警告したことを受けて、ドル売り・円買いが強まった。そして、FOMC で政策金利の据え置きが決定されたことを受けて、ドルは主要通貨に対して一段の下落となったが、経済活動は力強いペースで拡大しているとの認識が示され、利上げのペースは変わらないとの見方を背景に、終盤には値を戻した。

主要な米経済指標結果

7 月 ADP 雇用統計 21.9 万人（予想 18.6 万人・前回 17.7 万人⇒18.1 万人）

7 月の米 ADP 雇用統計では、民間の雇用者数の伸びが市場予想を上回り、5 ヶ月ぶりの大幅増加となった。建設業や製造業を含む財生産部門の雇用は+4.2 万人、サービス業の雇用は+17.7 万人と 1 月以来の大幅な伸び。建設業は+1.7 万人、製造業は+2.3 万人、専門職・ビジネスサービス部門は+4.7 万人、娯楽・ホスピタリティー関連は+3.7 万人。また、従業員が 500 人以上の大企業の雇用者は+4.8 万人、50-499 人の中堅企業では+11.9 万人と 2014 年以来の大幅な伸び、49 人以下の小企業では+5.2 万人。



出所：Bloomberg

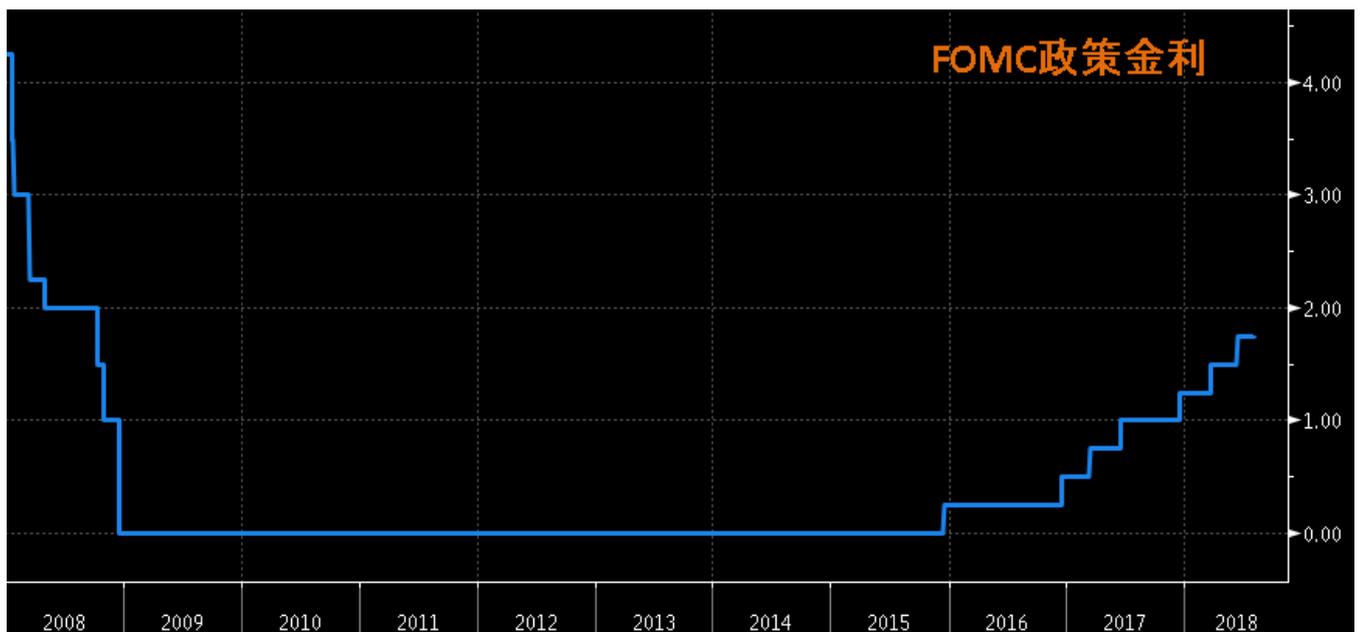
7 月 ISM 製造業景況指数 58.1（予想 59.3・前回 60.2）

7月の米ISM製造業景況指数は、市場予想を下回る低下となり、3ヵ月ぶりの低水準となった。貿易戦争による悪影響への懸念が長引く中、新規受注のこの1年余りの最低水準に落ち込んだことが要因となった。新規受注は60.2（前月63.5）と2017年5月以来の低水準、生産の指数は58.5（前月62.3）。雇用指数は56.5（前月56）、仕入れ価格指数は73.2（76.8）と1月以来の低水準。



出所：Bloomberg

FOMC 政策金利 1.75%-2.00%（予想 1.75%-2.00%・前回 1.75%-2.00%）



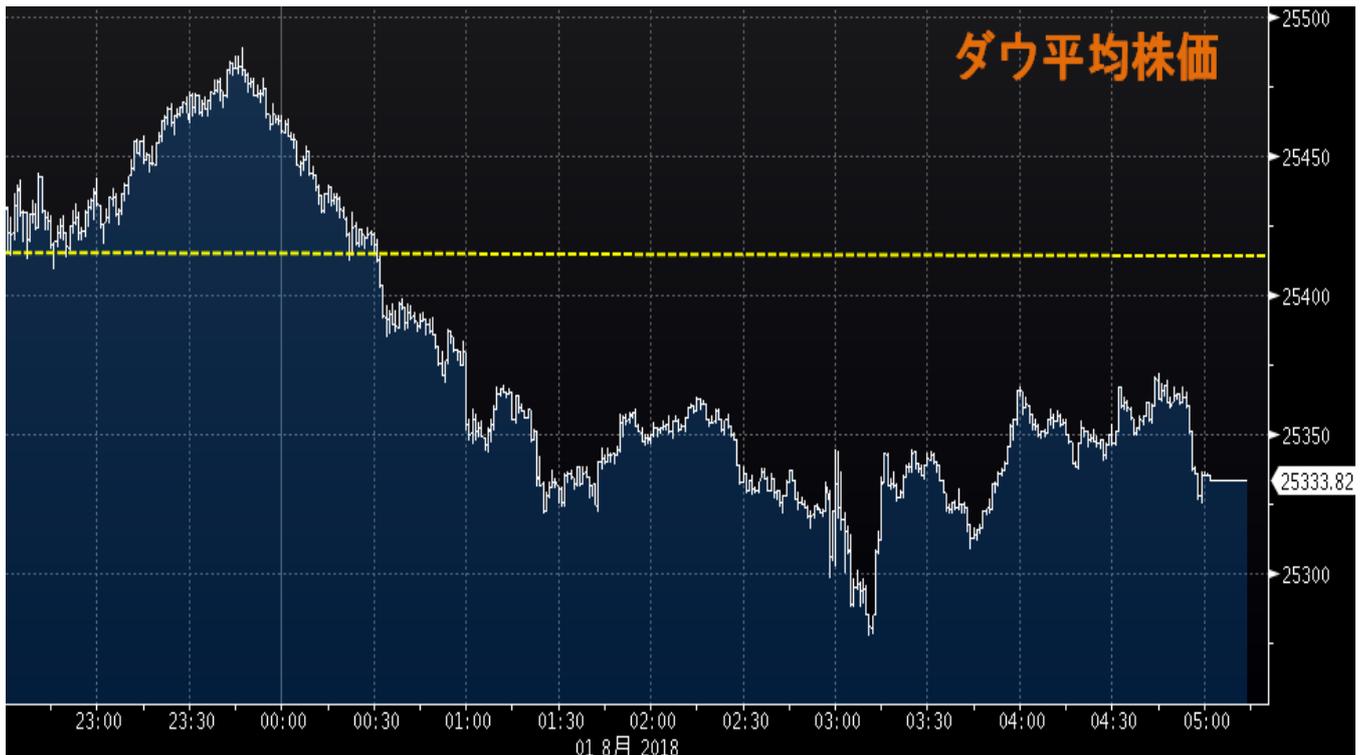
出所：Bloomberg

FOMC 声明

- ・ FF 金利誘導目標を 1.75-2.00%のレンジで据え置き。
- ・ 経済成長は力強い。
- ・ 労働市場が引き締められ続け、経済活動が力強い速度で拡大していることを示している。
- ・ 雇用の伸びは概してここ数ヵ月堅調で、失業率は低いままだった。
- ・ 家計支出と企業の設備投資は力強く伸びた。
- ・ 全体のインフレ率と食品やエネルギー以外のインフレ率はともに 2%近くにとどまっている。
- ・ 長期的なインフレ期待の指標は、総じてあまり変わっていない。
- ・ 委員会は法律上与えられた責務に従って、雇用最大化と物価安定の促進を目指す。
- ・ さらなる緩やかな FF 金利の目標誘導レンジの引き上げが、経済活動の持続的な拡大、力強い労働市場の状況、中期的に委員会の対称的な目標である 2%に近いインフレ率と整合すると予想する。
- ・ 経済見通しへのリスクはおおむね安定しているとみられる。
- ・ 据え置きは、労働市場の状況とインフレ率の実績と見通しを考慮。
- ・ 金融政策の運営姿勢は引き続き緩和的で、それによって力強い労働市場の状況と、2%のインフレへの持続的な回帰を支える。
- ・ FF 金利の目標誘導レンジの将来的な調整の時期と規模を決めるに当たり、最大雇用の目標と対称的な 2%のインフレ目標との比較で経済状況の実績と見通しを評価する。

ダウ、S&P 反落、ナスダックは続伸

米株式市場は、前日に発表された電子機器大手の四半期決算が好調だったが好感され、主要株価は序盤から堅調な動きとなった。その後は、米中の貿易摩擦が深刻化すると懸念が広がり、売りが優勢となった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなったが、その後下落に転じ反落となった。一方、ハイテク株中心のナスダックは、電子機器大手の好決算が材料視され、続伸となった。



出所：Bloomberg

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	資本財	-1.76%	1	キャタピラー	-3.66%
2	素材	-1.18%	2	3M	-2.48%
3	石油・ガス	-0.96%	3	ウォルグリーンBA	-1.75%
4	消費者サービス	-0.74%	4	エクソン	-1.37%
	テクノロジー	1.93%		アップル	5.89%

出所：データを基に SBILM が作成

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。