

# NYマーケットレポート (2024年3月7日)

## 2024年3月7日(木)

アジア主要株価指数	終値	前日比	年初来%
日経平均	39,598.71	-492.07	18.33%
ハンセン指数	16,229.78	-208.31	-4.80%
上海総合	3,027.40	-12.53	1.76%
韓国総合	2,647.62	+6.13	-0.29%
豪ASX200	7,763.71	+30.18	2.28%
シンガポールST	3,133.78	-2.36	-3.29%
インドSENSEX	74,119.39	+33.40	2.60%

外国為替	終値	高値	安値
USD/JPY	148.02	149.37	147.59
EUR/JPY	162.03	162.78	160.56
GBP/JPY	189.55	190.19	188.24
AUD/JPY	97.98	98.08	97.44
EUR/USD	1.0946	1.0949	1.0868
BRL/JPY	29.888	30.059	29.719
RUB/JPY	1.584	1.608	1.579

欧州主要株価指数	終値	前日比	年初来%
英FT100	7,692.46	+13.15	-0.53%
仏CAC40	8,016.22	+61.48	6.27%
独DAX	17,842.85	+126.14	6.51%
スペインIBX35	10,319.60	+122.40	2.15%
イタリアFTSE MIB	33,418.68	+54.84	10.11%
トルコ・イスタンブール100	9,054.18	+309.60	21.20%
ロシアRTS	1,152.12	+0.44	6.34%
南ア全株指数	73,604.11	+25.93	-4.28%

Commodity	終値	前日比	年初来%
NY GOLD	2,165.20	+7.00	3.49%
NY 原油	78.93	-0.20	10.67%
CBOTコーン	438.00	+9.25	-6.96%
CRB指数	279.09	+0.971	5.79%
ドル指数先物	102.818	-0.551	1.44%
VIX指数	14.44	-0.06	15.98%

米主要株価指数	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	38,791.35	+130.30	2.92%
S&P500	5,157.36	+52.60	8.12%
NASDAQ	16,273.38	+241.84	8.41%

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	21,794.56	+200.60	3.99%
メキシコ・ボルサ指数	55,049.49	-235.02	-4.07%
ブラジル・ボベスパ指数	128,339.76	-550.47	-4.36%

Crypto Currency	終値	前日
CME Bitcoin(先物・期翌)	67880	67135
XRP(Ripple)【BSTP】	0.638	0.616
Ethereum【BSTP】	3876.23	3853.17
Bitcoin Cash	438.37	416.37

オセアニア国債利回り	終値	前日
オーストラリア10年債	4.006%	4.005%
ニュージーランド10年債	4.597%	4.619%

日本国債利回り	終値	前日
2年債	0.195%	0.190%
10年債	0.731%	0.717%
30年債	1.767%	1.762%

### 3/8 経済指標スケジュール

08:30	【日本】1月家計調査消費支出
08:50	【日本】1月貿易収支
08:50	【日本】1月経常収支
13:30	【日本】2月企業倒産件数
14:00	【日本】2月景気ウォッチャー調査
14:00	【日本】1月景気先行CI指数
14:00	【日本】1月景気一致CI指数
16:00	【ドイツ】1月鉱工業生産
16:00	【ドイツ】1月生産者物価指数
16:45	【フランス】1月経常収支
16:45	【フランス】1月貿易収支
19:00	【欧州】4Q GDP
19:00	【欧州】4Q雇用者数
22:30	【米国】2月失業率
22:30	【米国】2月非農業部門雇用者数
22:30	【米国】2月製造業雇用者数
22:30	【米国】2月平均時給
22:30	【カナダ】2月失業率
22:30	【カナダ】2月雇用ネット変化率

欧州国債利回り	終値	前日
ドイツ10年債	2.304%	2.319%
英国 10年債	3.995%	3.989%
フランス 10年債	2.750%	2.771%
イタリア 10年債	3.614%	3.638%
スペイン 10年債	3.116%	3.142%

米国債利回り	終値	前日
2年債	4.501%	4.554%
10年債	4.083%	4.102%
30年債	4.242%	4.240%

### 3/8 主要会議・講演・その他予定

- NY連銀総裁 講演
- 米国夏時間移行 (10日~)

## NY 市場レポート（前日 22 時 00 分～午前 6 時 30 分まで）

### 欧州の主要な経済指標の結果

ECB 政策金利 4.50%（予想 4.50%・前回 4.50%）

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

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

### ECB 声明

- ・ 前回理事会以降インフレはさらに低下した。
- ・ インフレ率は 2024 年に平均 2.3%、2025 年に 2.0%、2026 年に 1.9%と予測。
- ・ エネルギーと食品を除くインフレ予測も下方修正され、2024 年は平均 2.6%、2025 年は 2.1%、2026 年は 2.0%となる。
- ・ 経済活動は短期的には引き続き低迷すると予想。
- ・ 必要な限り政策金利が十分に制限的な水準に設定される必要。
- ・ 金利決定は今後発表される経済・金融データ、基調的なインフレの動向、金融政策の波及力の強さを踏まえたインフレ見通しの評価に基づいて決定される。

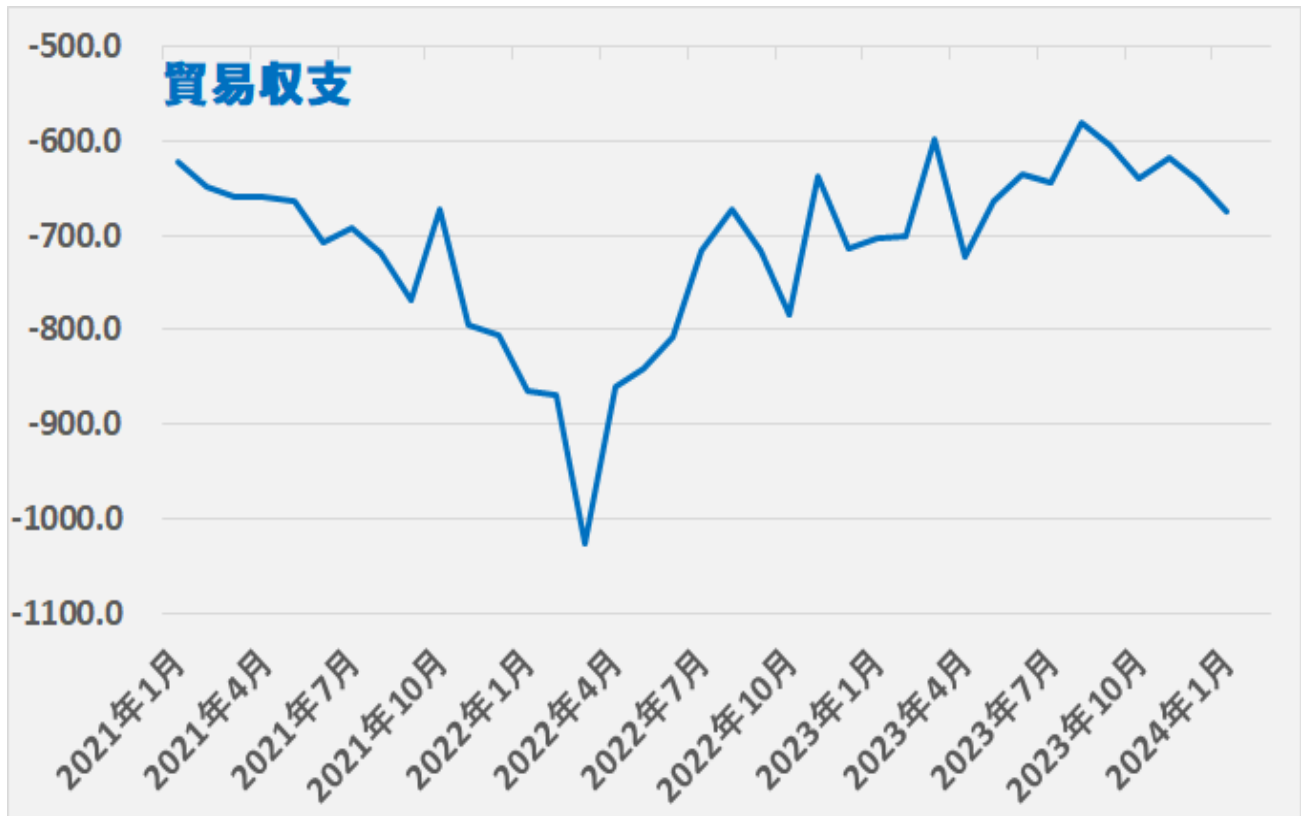
### ラガルド ECB 総裁

- ・ 景気は依然として弱い
- ・ 消費者は支出を控えている
- ・ 年内に景気は徐々に回復していくと調査は示唆
- ・ インフレに関する確信は十分ではない
- ・ 4 月にはもう少し 6 月にははるかにもっと状況分かる
- ・ 6 月にさらなるデータ得られると幅広い合意
- ・ 総合インフレ率はまだ目標に達していない
- ・ ECB の景気抑制的な政策の時期しばらく続く
- ・ 将来の金利の動きのペースを約束はしない
- ・ ECB の決定は全会一致

### 米国の主要な経済指標の結果

1月貿易収支 -677億USD（予想 -635億USD・前回 -622億USD⇒-642億USD）

1月の米貿易収支では、赤字額が前月比+5.1%と2ヵ月連続で拡大した。輸出は+0.1%の2574.9億ドル、輸入は+1.1%の3246.3億ドルとなった。また、対日赤字は+29.3%の68.2億ドル、対中赤字も+7.4%の237.1億ドルだった。

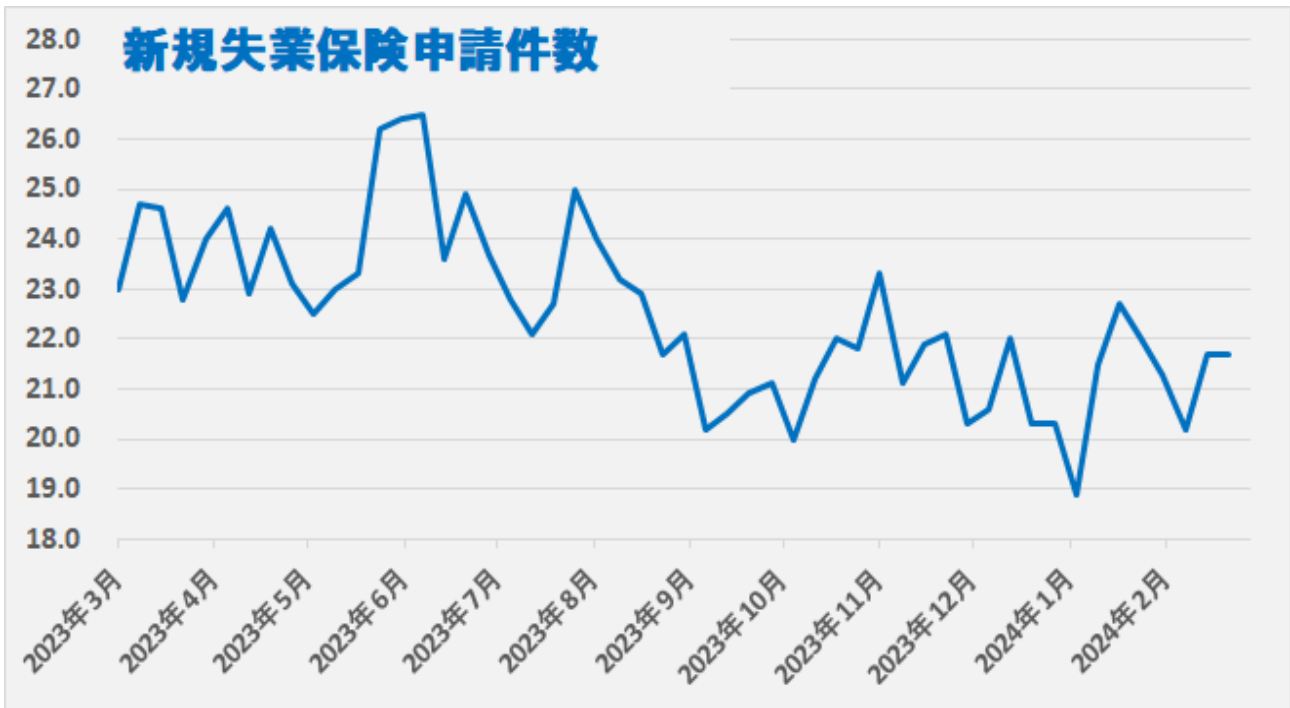


データを基に SBILM が作成

新規失業保険申請件数 21.7万件（予想 21.8万件・前回 21.5万件⇒21.7万件）

失業保険継続受給者数 190.6万人（予想 187.0万人・前回 190.5万人⇒189.8万人）

米新規失業保険申請件数（3/2までの週）は、市場予想の範囲内の結果となり、低水準を維持して労働市場の底堅さが続いていることが示された。一方、失業保険継続受給者数（2/2までの週）は市場予想を上回り、昨年11/17までの週以来の高水準となった。



データを基に SBILM が作成



データを基に SBILM が作成

## 主要株価指数は続伸

米株式市場では、パウエル FRB 議長が議会証言でインフレの鈍化に楽観的な見方を示したことで、FRB の早期の利下げ開始観測を背景に、主要株価指数は序盤から堅調な動きとなった。なお、投資判断が引き上げた半導体大手が大幅上昇したこともあり、ナスダックは上げ幅が拡大した。また、S&P500 は史上最高値を更新した。ダウ平均は、序盤から堅調な動きとなり、一時前日比 249 ドル高まで上昇した。ただ、その後は上値の重い動きが続き、130.30 ドル高 (+0.34%) で終了。一方、ハイテク株中心のナスダックは 241.84 ポイント高 (+1.51%) 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	資本財	0.88%	1	インテル	3.68%
2	エネルギー	0.70%	2	アメリカンエキスプレス	2.28%
3	テクノロジー	0.68%	3	アマゾン	1.91%
4	消費財	0.43%	4	マイクロソフト	1.75%
5	ヘルスケア	0.22%	5	キャタピラー	1.37%

データを基に SBILM が作成

## ドルは主要通貨に対して軟調

NY 市場では、日銀審議委員の発言を受けて、日銀の早期の政策修正観測が高まった流れを引き継ぎ、ドル円・クロス円は序盤から軟調な動きとなった。さらに、米長期金利の低下もドルの圧迫要因となり、ドル/円は序盤の 147.93 から 147.59 まで下落し、2/2 以来の安値となった。下げ一服後は、米長期金利が持ち直したこともあり、ドル/円は 148.30 まで値を戻したものの、パウエルFRB 議長が前日に続き議会証言で年内の利下げの可能性を示唆したこともあり、ドルは上値の重い動きが続いた。一方、ECB 理事会の声明で今年のインフレ率見通しを下方修正したものの、ラガルド ECB 総裁が会見で慎重な姿勢を示したことから、ECB の早期の利下げ観測が後退してユーロ買いが優勢となり、ユーロは対ドルで 1/16 以来の高値を付けた。



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。