

NY マーケットレポート (2018年2月1日)

2018年2月1日 (木)

アジア主要株価	終値	前日比	年初来%	TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
日経平均	23486.11	+387.82	3.17%	USD/JPY	109.59	109.64	109.10
ハンセン指数	32642.09	-245.18	9.10%	EUR/JPY	135.92	135.94	135.46
上海総合	3446.98	-33.85	4.23%	GBP/JPY	155.58	155.62	154.90
豪ASX200	6090.07	+52.38	0.41%	AUD/JPY	87.81	88.12	87.73
インドSENSEX	35906.66	-58.36	5.43%	EUR/USD	1.2403	1.2429	1.2386

欧州主要株価	終値	前日比	年初来%	NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
英FT100	7490.39	-43.16	-2.57%	USD/JPY	109.35	109.68	109.23
仏CAC40	5454.55	-27.38	2.67%	EUR/JPY	136.76	136.96	135.98
独DAX	13003.90	-185.58	0.67%	GBP/JPY	156.01	156.14	155.24
スペインIBX35	10399.00	-52.50	3.54%	AUD/JPY	87.94	87.98	87.50
南ア全株指数	59258.37	-247.75	-0.41%	EUR/USD	1.2508	1.2522	1.2432

米国主要株価	終値	前日比	年初来%	コモディティ	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	26186.71	+37.32	5.94%	NY GOLD	1347.90	+4.80	3.7%
S&P500	2821.98	-1.83	5.55%	NY 原油	65.80	+1.07	9.3%
NASDAQ	7385.86	-25.62	6.99%	COBTコーン	361.75	+0.25	3.1%
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%	CRB指数	198.35	+0.97	1.8%
トロント総合	15860.92	-90.75	-2.15%	ドル指数先物	88.95	-0.54	-3.84%
ボルサ指数	50591.15	+134.98	2.51%	VIX指数	13.35	-0.19	19.4%
ボエスバ指数	85495.25	+582.55	11.90%				

*一部6時時点

*一部暫定値

2/2 経済指標スケジュール

- 08:50 【日本】1月マネタリーベース
- 09:30 【オーストラリア】4Q生産者物価指数
- 18:00 【ノルウェー】1月失業率
- 18:30 【英国】1月建設業PMI
- 19:00 【欧州】12月生産者物価指数
- 22:00 【シンガポール】1月電子産業指数
- 22:00 【シンガポール】1月購買部景気指数
- 22:30 【米国】1月失業率
- 22:30 【米国】1月非農業部門雇用者数
- 22:30 【米国】1月平均時給
- 23:00 【メキシコ】12月景気先行指数
- 00:00 【米国】1月ミシガン大学消費者信頼感指数
- 00:00 【米国】12月製造業受注指数
- 00:00 【米国】12月耐久財受注

2/2 主要会議・講演・その他予定

- ・サンフランシスコ連銀総裁 講演
- ・イエレンFRB議長 退任(3日)
- ・パウエルFRB議長 就任(3日、就任宣誓は5日)

Crypto Currency	本日	前日
CBOE Bitcoin(先物・期近)	9080	9940
CME Bitcoin(先物・期近)	9040	9925
Ripple (BSTP)	0.959	1.084
Ethereum (BSTP)	1010.31	1093.22
Bitcoin Cash	1304.35	1458.98

*USD 6:50時点

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.12%	-0.13%
5年債	-0.06%	-0.09%
10年債	0.08%	0.09%
30年債	0.83%	0.82%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.72%	0.70%
英国 10年債	1.53%	1.51%
フランス 10年債	0.98%	0.97%
米国債利回り		
2年債	2.16%	2.15%
3年債	2.32%	2.29%
5年債	2.57%	2.52%
7年債	2.72%	2.66%
10年債	2.78%	2.71%
30年債	3.02%	2.94%

NY 市場レポート

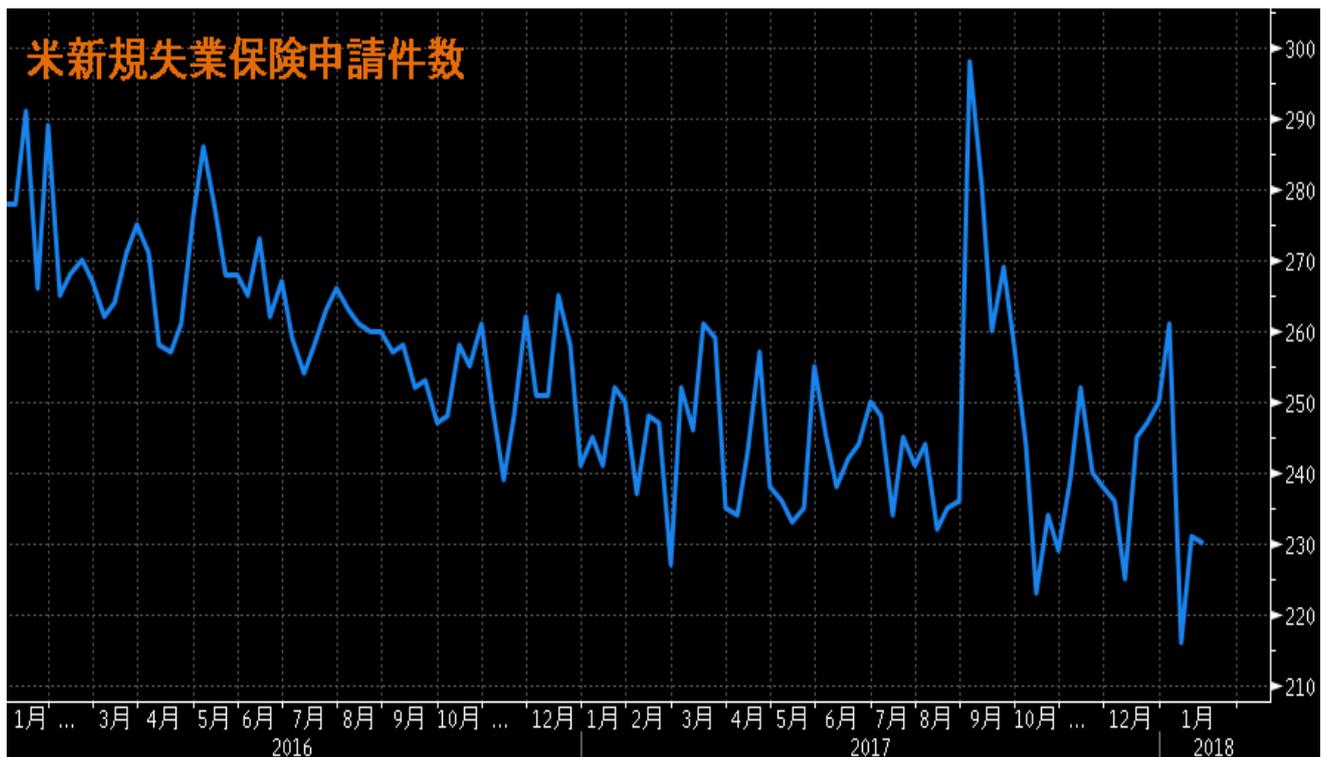
<< NY 市場概況 >>

NY 市場では、序盤に発表された米失業保険申請件数が予想より良好な結果となったものの、米非農業部門労働生産性が7四半期ぶりマイナスとなったことを受けて、ドルは軟調な動きとなった。また、その後に発表された米 ISM 製造業景況指数、建設支出は、市場予想を上回ったものの、前回結果が下方修正されたことや、ISM の雇用指数が昨年 5 月以来の低水準となったことが嫌気され、ドルは上値の重い動きとなった。下げ一巡後は、下落して始まった米主要株価が上昇に転じたことや、米長期債利回りの上昇を受けて、ドル円・クロス円は堅調な動きとなった。ただ、引けにかけて株価が再びマイナス圏まで下落する動きとなったことから、ドル円・クロス円も上値の重い動きとなった。

主要な経済指標結果

米新規失業保険申請件数 23.0 万件（予想 23.5 万件・前回 23.3 万件⇒23.1 万件）

米失業保険申請件数は、前週比で-0.1 万件の 23.0 万件となり、2 週ぶりに減少した。申請件数の 4 週移動平均は、前週比-0.5 万件の 23 万 4500 件。また、集計が 1 週遅れる失業保険継続受給者数は、前週比+1.3 万人の 195.3 万人と 2 週ぶりに増加。受給者数の 4 週移動平均は、前週比+1.2 万人の 193 万 2750 人。受給者比率は、前週比横ばいの 1.4%だった。



出所：Bloomberg

4Q 米非農業部門労働生産性（前期比年率） -0.1%（予想 0.7%・前回 3.0%⇒2.7%）

10-12月期の米非農業部門労働生産性（速報値）は、年率換算で前期比-0.1%となり、7四半期ぶりのマイナスとなった。労働時間の伸びが生産の増加を上回ったことが、生産性の低下につながった。賃金の指標である単位労働コストは、前期比+2.0%と3四半期ぶりの上昇。労働生産性では、生産が前期比で+3.2%、労働時間が+3.3%。時間当たりの労働報酬は、名目ベースで前期比+1.8%、物価動向を考慮した実質ベースでは-1.8%だった。



出所：Bloomberg

1月米ISM製造業景況指数 59.1（予想 58.6・前回 59.7⇒59.3）

1月の米ISM製造業景況指数は59.1となり、市場予想を上回る結果となった。ただ、前回結果が下方修正された。関連指数では、仕入れ価格が72.7（前回68.3）、受注残が56.2（54.9）、在庫が52.3（48.5）と前月から上昇した。ただ、新規受注が65.4（前回67.4）、生産が64.5（65.2）、雇用が54.2（58.1）と前月から低下、特に雇用は昨年5月以来の低水準となった。



出所：Bloomberg

米 30 年債利回りが 3% を突破

米債券市場では、米 FOMC 声明の内容を受けて 3 月の追加利上げへの警戒感が強まり、売りが先行した。また、米 ISM 製造業景況指数や建設支出が市場予想を上回ったことも国債の売り材料となり、長期債を中心に利回りは上昇となった。10 年債利回りは 2.7764% まで上昇、米 30 年債利回りは 3.0308% まで上昇し、昨年 5 月以来となる 3% 台乗せとなった。



出所：Bloomberg

ダウ平均株価は一時 157 ドル高も、その後マイナス圏まで下落

米株式市場は、米 FRB の追加利上げ観測が強まったことを嫌気した売りが先行した。しかし、金融機関が投資を推奨する銘柄に指定したとの報道を受けて、航空宇宙機器大手が買われたことなどがきっかけとなり、全体が押し上げられて主要株価はプラス圏まで上昇した。ただ、その後は上値の重い動きとなり、終盤には再びマイナス圏まで下落する動きとなった。ダウ平均株価は、小幅高となったが、ナスダックはマイナス圏で引けた。



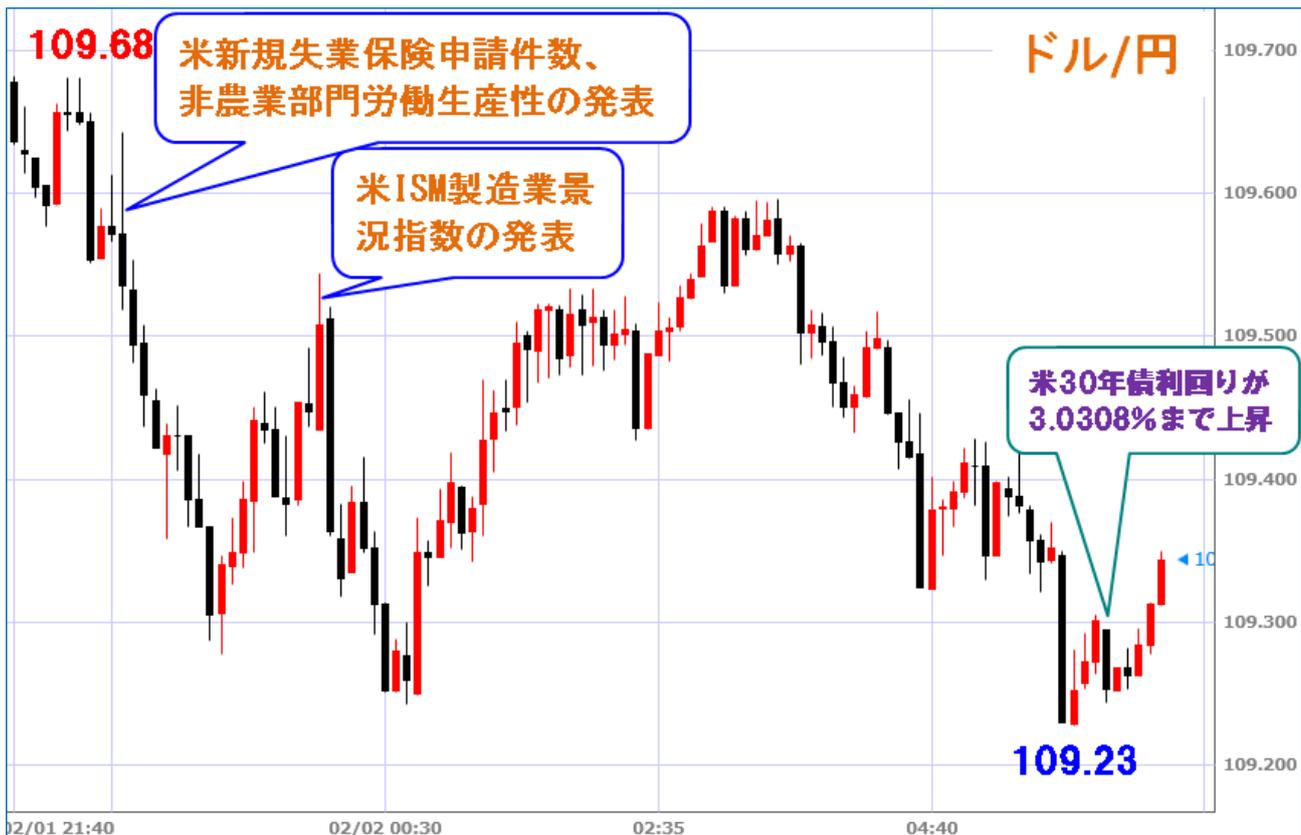
出所：Bloomberg

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	金融	1.02%	1	エクソン	2.03%
2	石油・ガス	0.94%	2	Wディズニー	1.67%
3	通信サービス	0.43%	3	GS	1.62%
4	ヘルスケア	0.14%	4	J&J	1.32%
	素材	-2.75%	5	ピザ	1.20%

出所：データを基にSBILMが作成

ドル上昇も上値の重い動き

NY市場では、週末の米雇用統計の発表を控えて、雇用関連の指標結果や指数が低迷したことが意識され、ドルは序盤やや軟調な動きとなった。ただ、下げ一服後は米長期債利回りの上昇が続いたことから、ドル買い・円売りとなり、クロス円も堅調な動きとなった。ただ、引けにかけて株価が再びマイナス圏まで下落したことや、米雇用統計を控えたポジション調整の動きも見られ、ドルは主要通貨に対して上値の重い動きとなった。



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。