

NY マーケットレポート (2018年2月5日)

2018年2月5日 (月)

| 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 | 22682.08 | -592.45 | -0.36% | USD/JPY | 109.92 | 110.29 | 109.80 |
| ハンセン指数 | 32245.22 | -356.56 | 7.77% | EUR/JPY | 136.73 | 137.20 | 136.70 |
| 上海総合 | 3487.50 | +25.42 | 5.45% | GBP/JPY | 154.87 | 155.55 | 154.86 |
| 豪ASX200 | 6026.23 | -95.16 | -0.64% | AUD/JPY | 87.07 | 87.32 | 86.88 |
| インドSENSEX | 34757.16 | -309.59 | 2.06% | EUR/USD | 1.2440 | 1.2467 | 1.2424 |

| 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 | 7334.98 | -108.45 | -4.59% | USD/JPY | 109.24 | 110.27 | 109.00 |
| 仏CAC40 | 5285.83 | -79.15 | -0.50% | EUR/JPY | 135.36 | 136.96 | 135.07 |
| 独DAX | 12687.49 | -97.67 | -1.78% | GBP/JPY | 152.64 | 154.60 | 152.41 |
| スペインIBX35 | 10064.50 | -146.70 | 0.21% | AUD/JPY | 86.10 | 87.51 | 85.91 |
| 南ア全株指数 | 57113.74 | -1543.08 | -4.02% | EUR/USD | 1.2392 | 1.2449 | 1.2383 |

| 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 | 24345.75 | -1175.21 | -1.51% | NY GOLD | 1336.50 | -0.80 | 2.8% |
| S&P500 | 2648.94 | -113.19 | -0.92% | NY 原油 | 64.15 | -1.30 | 4.8% |
| NASDAQ | 6967.53 | -273.42 | 0.93% | COBTコーン | 358.75 | -2.75 | 2.3% |
| 南北米主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% | CRB指数 | 195.67 | -1.77 | 0.9% |
| トロント総合 | 15334.81 | -271.22 | -5.39% | ドル指数先物 | 89.58 | +0.38 | -2.71% |
| ボルサ指数 | 休 場 | | | VIX指数 | 34.65 | +17.31 | 178.2% |
| ボベスパ指数 | 81861.09 | -2180.26 | 7.15% | | | | |

*メキシコ市場は憲法記念日で休場 x一部暫定値

2/6 経済指標スケジュール

| | |
|-------|-------------------------|
| 09:01 | 【英国】1月BRC小売売上高[既存店] |
| 09:30 | 【オーストラリア】12月貿易収支 |
| 09:30 | 【オーストラリア】12月小売売上高 |
| 12:30 | 【オーストラリア】政策金利発表 |
| 16:00 | 【ドイツ】12月製造業受注 |
| 16:45 | 【フランス】12月財政収支 |
| 17:30 | 【ドイツ】1月建設業PMI |
| 17:30 | 【スウェーデン】12月鉱工業受注 |
| 18:10 | 【フランス】【ドイツ】【欧州】1月小売業PMI |
| 18:30 | 【南アフリカ】1月SACCI景況感指数 |
| 22:30 | 【米国】12月貿易収支 |
| 22:30 | 【カナダ】12月国際商品貿易 |
| 23:00 | 【メキシコ】1月消費者信頼感指数 |
| 23:00 | 【メキシコ】11月総設備投資 |
| 00:00 | 【米国】12月JOLT労働調査[求人件数] |
| 00:00 | 【カナダ】1月Ivey購買部協会指数 |

2/6 主要会議・講演・その他予定

・セントルイス連銀総裁 講演

| Crypto Currency | 本日 | 前日 |
|---------------------|--------|---------|
| CBOE Bitcoin(先物・期近) | 7060 | 8540 |
| CME Bitcoin(先物・期近) | 7210 | 8495 |
| Ripple (BSTP) | 0.697 | 0.822 |
| Ethereum (BSTP) | 715.12 | 811.58 |
| Bitcoin Cash | 918.77 | 1254.55 |

*USD 7:00時点

| 日本国債利回り | 本日 | 前日 |
|-----------|--------|--------|
| 2年債 | -0.13% | -0.13% |
| 5年債 | -0.08% | -0.07% |
| 10年債 | 0.08% | 0.09% |
| 30年債 | 0.82% | 0.82% |
| 欧州国債利回り | | |
| ドイツ10年債 | 0.74% | 0.77% |
| 英国 10年債 | 1.56% | 1.58% |
| フランス 10年債 | 1.00% | 1.02% |
| 米国債利回り | | |
| 2年債 | 2.02% | 2.14% |
| 3年債 | 2.18% | 2.32% |
| 5年債 | 2.44% | 2.59% |
| 7年債 | 2.61% | 2.76% |
| 10年債 | 2.71% | 2.84% |
| 30年債 | 3.01% | 3.08% |

NY 市場レポート

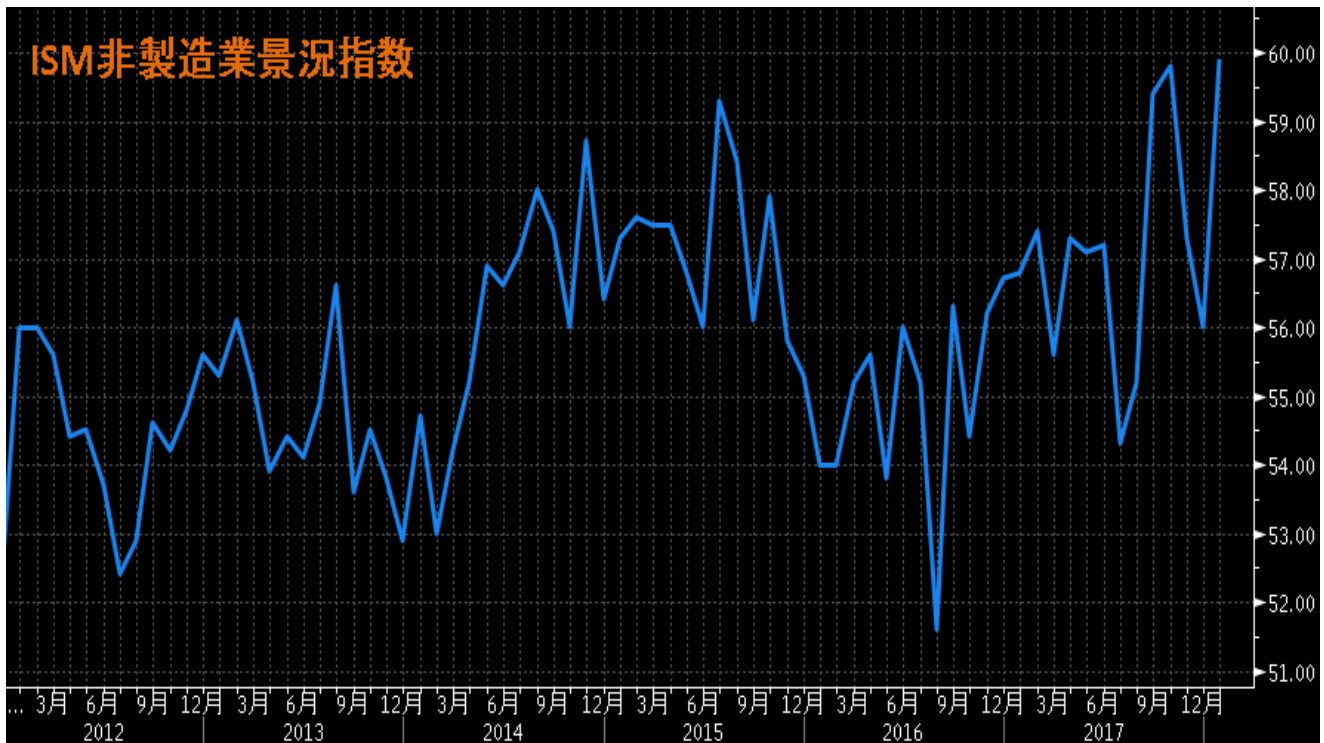
◀ NY 市場概況 ▶

NY 市場では、米国の利上げペースが加速するとの観測などを背景に、企業業績を圧迫するとの懸念から株価が大きく下落となったことを受けて、リスク回避の動きが強まり、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。また、米国の移民関連法の成立見通しが後退し、暫定予算案が通過する可能性が低下しているとの懸念もリスク回避の動きを後押しした。また、米株式市場は、序盤から軟調な動きとなり、ダウ平均株価は一時 1597 ドル安まで下落するなど、過去最大の下げ幅となった。

主要な経済指標結果

1 月 ISM 非製造業景況指数 59.9 (予想 56.7・前回 55.9⇒56.0)

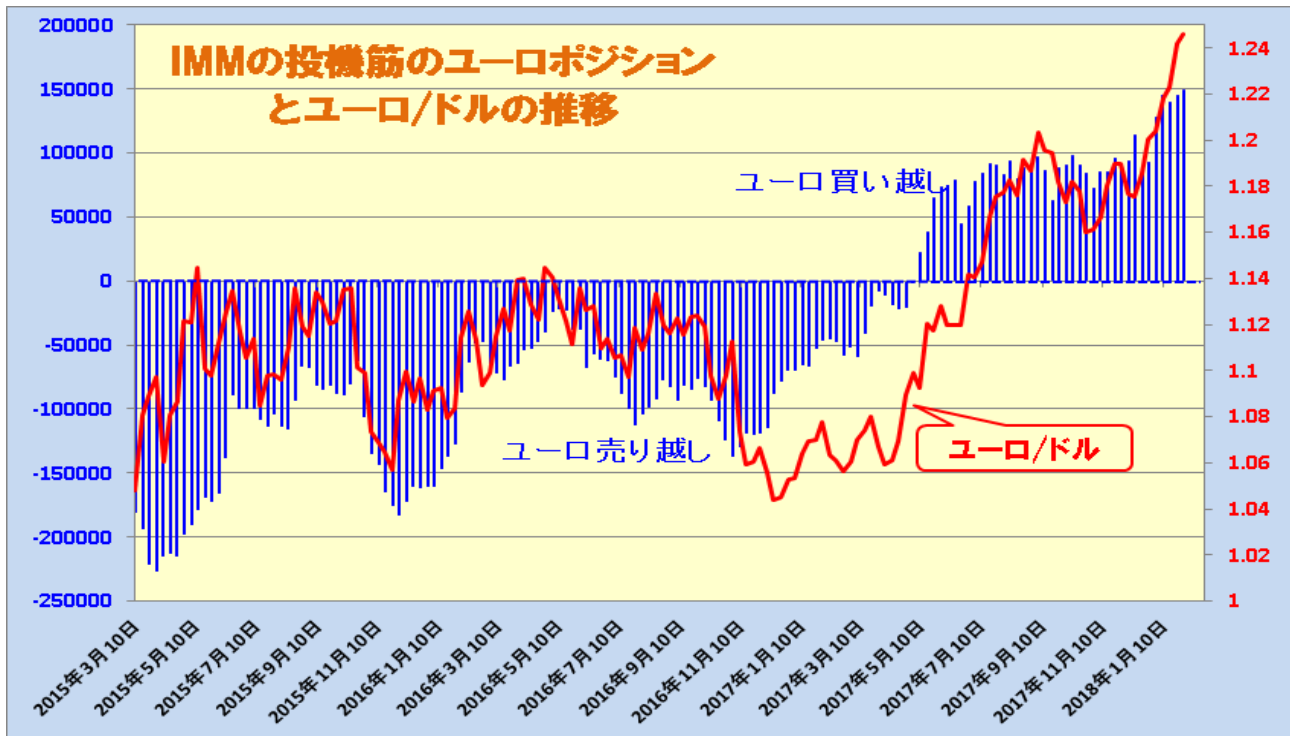
1 月の米 ISM 非製造業景況指数は、59.9 と前月改定値の 56.0 から 3.9 ポイント上昇した。主な副指数は事業活動が 59.8 (前月 57.8)、新規受注が 62.7 (54.5)、雇用が 61.6 (56.3)、仕入れ価格が 61.9 (59.9) といずれも前月から上昇となった。一方、在庫は 49.0 (53.5) に低下した。1 月は 15 業種が景況拡大を報告、業況が縮小したのは 3 業種だった。



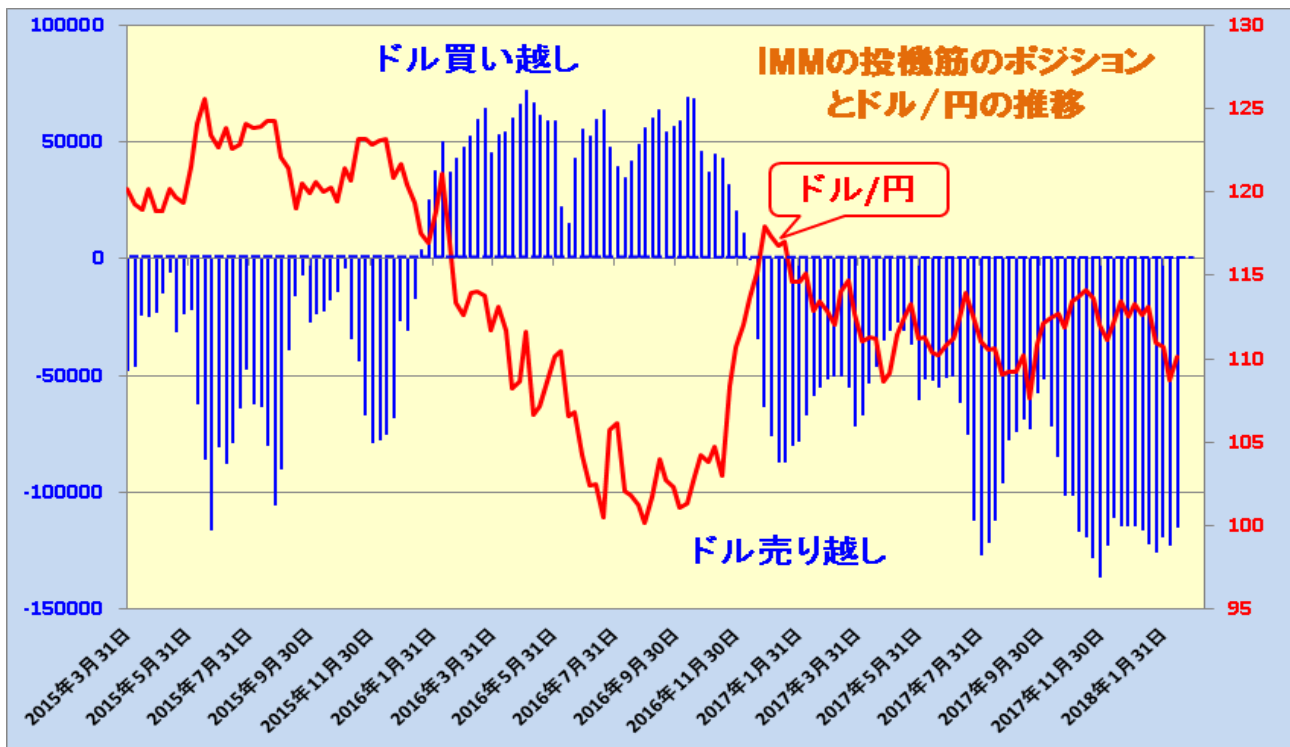
出所：Bloomberg

ユーロの買い越しが過去最高を更新

CFTC（米商品先物取引委員会）が発表したデータによると、IMM 通貨先物の投機部門の取組（1/30 までの 1 週間）では、ユーロの買い越しが前週の 14 万 4717 枚から 14 万 8742 枚に増加し、過去最高を更新した。一方、ドルの主要 6 通貨（円、ユーロ、ポンド、スイスフラン、カナダドル、豪ドル）に対する売り越し額は 137 億 3000 万ドルと昨年 10 月中旬以来の水準に増加した。また、円の売り越しは 12 万 2870 枚から 11 万 4696 枚にやや減少。



出所：CFTC データを基に SBILM が作成



出所：CFTC データを基に SBILM が作成

ダウ平均株価、下げ幅は史上最大

米国の主要な経済指標が良好な結果となり、米国の利上げペースが加速するとの思惑などもあり、主要株価は大幅安となった。ダウ平均株価は、一時前週末比 1597 ドル安まで下落する場面もあった。終値ベースでは、2017/12/8 以来、約 2 ヶ月ぶりの安値水準となった。



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 | -5.35% | 1 | ボーイング | -5.74% |
| 2 | 石油・ガス | -5.30% | 2 | エクソン | -5.69% |
| 3 | ヘルスケア | -5.00% | 3 | 3M | -5.60% |
| 4 | 通信サービス | -4.68% | 4 | ホームデポ | -5.60% |
| 5 | 金融 | -4.35% | 5 | ユナイテッドT | -5.48% |

出所：データを基に SBILM が作成

株価下落の影響を受けて、リスク回避の円買い

米国の利上げペースの加速観測を背景に、株価が大幅下落となったことや、移民関連法の成立見通しが暗く、新たな暫定予算案が通過する可能性が低下していることも影響し、投資家のリスク回避の動きが強まり、ドル円・クロス円は軟調な動きが続いた。一方、ドラギ ECB 総裁が、最近の為替レートの変動から、新たな逆風が生じていると発言したことを受けて、ユーロは軟調な動きとなった。



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。