

NY マーケットレポート (2018 年 2 月 8 日)

2018年2月8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	21890.86	+245.49	-3.84%	USD/JPY	109.54	109.78	109.12
ハンセン指数	30451.27	+128.07	1.78%	EUR/JPY	134.34	134.80	133.88
上海総合	3262.05	-47.21	-1.36%	GBP/JPY	152.04	152.62	151.45
豪ASX200	5890.70	+13.89	-2.88%	AUD/JPY	85.78	85.98	85.30
インドSENSEX	34413.16	+330.45	1.05%	EUR/USD	1.2260	1.2295	1.2252

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	7170.69	-108.73	-6.73%	USD/JPY	108.72	109.73	108.59
仏CAC40	5151.68	-104.22	-3.03%	EUR/JPY	133.16	134.65	132.94
独DAX	12260.29	-330.14	-5.09%	GBP/JPY	151.18	154.04	150.84
スペインIBX35	9756.30	-220.60	-2.86%	AUD/JPY	84.63	85.74	84.52
南ア全株指数	56635.69	-250.76	-4.82%	EUR/USD	1.2248	1.2295	1.2233

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	23860.46	-1032.89	-3.47%	NY GOLD	1319.00	+4.40	1.2%
S&P500	2581.00	-100.66	-3.46%	NY 原油	61.15	-0.64	0.0%
NASDAQ	6777.16	-274.82	-1.83%	COBTコーン	365.75	+0.50	4.3%
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%	CRB指数	191.77	-0.57	-1.1%
トロント総合	15065.61	-264.97	-7.05%	ドル指数先物	90.30	+0.05	-1.98%
ボルサ指数	47862.10	-1114.35	-3.02%	VIX指数	33.46	+5.73	201.1%
ボバスパ指数	81532.53	-1234.20	6.72%				

※一部暫定値

2/9 経済指標スケジュール

08:50	【日本】1月マネーストックM2
09:30	【オーストラリア】2月四半期金融政策報告
09:30	【オーストラリア】12月投資貸付
09:30	【オーストラリア】12月住宅ローン約定件数
10:30	【中国】1月生産者物価指数・1月消費者物価指数
13:30	【日本】12月第三次産業活動指数
15:45	【スイス】1月失業率
16:00	【ノルウェー】4Q GDP
16:00	【ノルウェー】1月消費者物価指数・1月生産者物価指数
16:45	【フランス】12月鉱工業生産
16:45	【フランス】12月製造業生産指数
17:30	【スウェーデン】12月個人消費
18:30	【英国】12月鉱工業生産
18:30	【英国】12月製造業生産高
18:30	【英国】12月商品貿易収支
21:00	【英国】1月NIESR GDP予想
22:30	【カナダ】1月失業率
22:30	【カナダ】1月雇用ネット変化率
22:30	【カナダ】1月労働参加率
23:00	【メキシコ】12月鉱工業生産
23:00	【メキシコ】12月製造業生産
00:00	【米国】12月卸売在庫
00:00	【米国】12月卸売売上高

2/9 主要会議・講演・その他予定

・冬季五輪 (～25日)

Crypto Currency	本日	前日
CBOE Bitcoin(先物・期近)	8320	8280
CME Bitcoin(先物・期近)	8325	8205
Ripple (BSTP)	0.744	0.758
Ethereum (BSTP)	803.21	818.85
Bitcoin Cash	1343.68	1003.11

※USD 7:00時点

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.15%	-0.15%
5年債	-0.08%	-0.08%
10年債	0.08%	0.08%
30年債	0.82%	0.82%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.76%	0.75%
英国 10年債	1.62%	1.55%
フランス 10年債	1.00%	0.98%
米国債利回り		
2年債	2.10%	2.12%
3年債	2.30%	2.32%
5年債	2.54%	2.56%
7年債	2.73%	2.74%
10年債	2.82%	2.84%
30年債	3.13%	3.11%

NY 市場レポート

« NY 市場概況 »

NY 市場では、米議会が歳出上限の引き上げで合意したことを背景に、米国の財政赤字拡大に伴う国債増発懸念に加え、英中銀が早期の追加利上げを示唆したことから、米英の金融引き締めペース加速の可能性が意識され、米長期金利が上昇する動きとなった。そして、金利上昇懸念が再燃したことから、再び米主要株価が大幅下落となり、投資家のリスク回避の動きが強まったことから、安全資産とされる円が買われる動きとなり、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。

英国の金融政策発表～英ポンド上昇

- ・ 9 対 0 で政策金利据え置きを決定、資産購入計画は据え置き。
- ・ 成長見通し引き上げ、インフレ率は目標水準上回り続ける。

カーニー英中銀総裁

- ・ 利上げは限定的な度合いで段階的に行うことが必要だが、昨年 11 月に考えていたよりも幾分早期かつ大幅になる公算。
- ・ 需要の拡大が供給の伸びを上回る見込みだ。

カーニー英中銀総裁の記者会見での発言を受けて、早期の利上げ観測が強まり、ポンドは主要通貨に対して上昇した。



出所：総合分析チャート

米国の主な要人発言

ダドリー・NY連銀総裁

- ・株安、もっと続けば支出に影響及ぼす可能性も
- ・今年の利上げ回数、1-4回とみるのは時期尚早
- ・今年4回の利上げはあり得る、景気見通し上向けば
- ・長期金利の上昇はFOMCの金利見通しが一因
- ・金融引き締め時の市場織り込み具合は適切
- ・強すぎる経済、さらなる金融引き締めにつながり得る
- ・米政府の債務返済コスト、大幅上昇へ
- ・インフレはなお2%未満、FOMCは辛抱できる

カシュカリ・ミネアポリス連銀総裁

- ・債券市場、インフレが統制下にあることを示唆
- ・債務増で米国の信頼がいずれ損なわれる恐れ

ハーカー・フィラデルフィア連銀総裁

- ・荒い相場変動、個人消費や設備投資に影響しない見通し
- ・18年はなお2回の利上げ予想、3回の可能性否定せず
- ・パウエル議長、緩和解除で大きな変化望まない
- ・ドル下落が続けばインフレーションに加速も
- ・インフレ上昇の一部はドルが左右
- ・長期的な州・連邦債務を懸念

序盤堅調な動きも、午後には上値が重く、反落となった

米株式市場は、米国の財政赤字拡大に伴う国債増発懸念を背景に、米長期金利が上昇傾向となったことに再び懸念が強まり、主要株価は大きく下落した。ダウ平均株価は、序盤から大きく下落し、前日比 1000 ドル以上の下落となった。この日は、構成する全銘柄が下落した。



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	-4.80%	1	アメリカンエキスプレス	-5.63%
2	金融	-4.68%	2	インテル	-5.42%
3	消費者サービス	-4.08%	3	キャタピラー	-5.42%
4	テクノロジー	-3.94%	4	ボーイング	-5.30%
5	通信サービス	-3.86%	5	ホームデポ	-5.26%

出所：データを基にSBILMが作成

米株価の大幅下落を背景に、リスク回避の動きが強まる

米主要株価が大幅下落して始まったのを受けて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となった。その後、一旦反発が見られたものの、終盤まで株価の下落が続いたこともあり、上値の重い動きが続いた。



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。