

NY マーケットレポート (2018年2月27日)

2018年2月27日 (火)

アジア主要株価	終値	前日比	年初来%
日経平均	22389.86	+236.23	-1.65%
ハンセン指数	31268.66	-229.94	4.51%
上海総合	3292.07	-37.51	-0.46%
豪ASX200	6056.86	+14.68	-0.14%
インドSENSEX	34346.39	-99.36	0.85%

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	107.02	107.10	106.79
EUR/JPY	132.05	132.09	131.67
GBP/JPY	149.66	149.67	149.17
AUD/JPY	84.00	84.16	83.82
EUR/USD	1.2340	1.2345	1.2309

欧州主要株価	終値	前日比	年初来%
英FT100	7282.45	-7.13	-5.27%
仏CAC40	5343.93	-0.33	0.59%
独DAX	12490.73	-36.31	-3.30%
スペインIBX35	9900.20	-2.20	-1.43%
南ア全株指数	59027.22	+158.29	-0.80%

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	107.39	107.67	106.96
EUR/JPY	131.31	131.87	131.31
GBP/JPY	149.32	149.62	148.85
AUD/JPY	83.60	84.02	83.59
EUR/USD	1.2227	1.2318	1.2222

米国主要株価	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	25410.03	-299.24	2.79%
S&P500	2744.28	-35.32	2.64%
NASDAQ	7330.35	-91.11	6.18%
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%
トロント総合	15671.15	-43.51	-3.32%
ボルサ指数	47970.19	-493.25	-2.80%
ボベスパ指数	86935.44	-717.20	13.79%

コモディティ	終値	前日比	年初来%
NY GOLD	1318.60	-14.20	1.2%
NY 原油	63.01	-0.90	4.0%
CBOTコーン	379.25	+2.00	5.6%
CRB指数	195.394	-1.356	0.8%
ドル指数先物	90.379	+0.526	-1.89%
VIX指数	18.59	+2.79	58.5%

x一部暫定値

2/28 経済指標スケジュール

08:50	【日本】1月鉱工業生産
08:50	【日本】1月百貨店・スーパー販売額
08:50	【日本】1月小売業販売額
09:00	【ニュージーランド】2月ANZ企業景況感
09:01	【英国】2月GfK消費者信頼感調査
10:00	【中国】1月製造業PMI・非製造業PMI
14:00	【日本】1月住宅着工戸数・1月建設工事受注
16:00	【ドイツ】3月GfK消費者信頼感調査
16:45	【フランス】1月生産者物価指数・2月消費者物価指数
16:45	【フランス】4Q GDP
16:45	【フランス】1月消費者支出
17:30	【スウェーデン】4Q GDP
17:55	【ドイツ】2月失業率・2月失業者数
18:00	【ポーランド】4Q GDP 季調済
18:30	【南アフリカ】1月生産者物価指数
19:00	【欧州】2月消費者物価指数
21:00	【南アフリカ】1月貿易収支・1月財政収支
21:00	【米国】MBA住宅ローン申請指数
22:30	【米国】4Q GDP
22:30	【米国】4Q個人消費
22:30	【カナダ】1月原料価格指数・1月鉱工業製品価格
23:45	【米国】2月シカゴ購買部協会景気指数
00:00	【米国】1月中古住宅販売仮契約

2/28 主要会議・講演・その他予定

・欧州議会本会議 (～3月1日)

Crypto Currency	本日	前日
CBOE Bitcoin(先物・期近)	10700	10320
CME Bitcoin(先物・期近)	10740	10250
Ripple (BSTP)	0.941	0.924
Ethereum (BSTP)	881.14	866.31
Bitcoin Cash	1243.88	1240.16

*USD 7:00時点

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.16%	-0.15%
5年債	-0.11%	-0.11%
10年債	0.05%	0.05%
30年債	0.76%	0.76%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.68%	0.65%
英国10年債	1.56%	1.51%
フランス10年債	0.95%	0.93%
米国債利回り		
2年債	2.26%	2.22%
3年債	2.42%	2.37%
5年債	2.66%	2.61%
7年債	2.83%	2.78%
10年債	2.89%	2.86%
30年債	3.16%	3.15%

NY 市場レポート

◀ NY 市場概況 ▶

NY 市場では、注目されたパウエル FRB 議長の就任以来初めてとなる議会証言で、「自身の米経済見通しは 12 月以降に強まっており、当局は利上げ軌道の見直しを検討するのが妥当かもしれない」と発言したことを受けて、利上げペースの加速が意識され、ドルは主要通貨に対して堅調な動きとなった。一方、ドイツのインフレ指標が予想より弱かったことが影響し、ユーロ/円は軟調な動きが続いた。また、株式市場では、追加利上げのペース加速への警戒感から大きく下落となり、原油や金市場では、ドル高でドル建ての割高感が嫌気され、大幅下落となった。

米主要経済指標の結果

1 月米耐久財受注 (前月比) -3.7% (予想 -2.0%・前回 2.8% ⇒ 2.6%)

1 月米耐久財受注 [除輸送用機器] -0.3% (予想 0.4%・前回 0.7%)

1 月の米耐久財受注は、前月比-3.7%の 2397 億 2400 万ドルと 3 ヶ月ぶりのマイナスとなり、2017 年 7 月以来 6 ヶ月ぶりの大きな減少率となった。輸送機器が-10.0%と 2017 年 7 月以来の落ち込みとなり、なかでも民間航空機が-28.4%、国防関連の航空機が-45.6%の大幅マイナスだったことが影響した。輸送機器を除いた受注は-0.3%となり、一次金属が-0.9%、一般機械が-0.4%、電機・家電が-0.8%、電算機・電子製品は+0.6%だった。



出所：Bloomberg

2 月米消費者信頼感指数 130.8 (予想 126.5・前回 125.4 ⇒ 124.3)

2 月米消費者信頼感指数は、130.8 (1985 年=100) と改定値の 124.3 から 6.5 ポイント上昇し、2000 年 11 月以来 17 年 3 ヶ月ぶりの高水準となった。景気の現状に対する信頼感指数は 162.4 (前月 154.7)、向こう半年の期待指数は 109.7 (104.0) といずれも前月から上昇した。雇用関連では、現状は「職が豊富」との回答は 39.4% (前月 37.2%)、「就職が困難」は 14.7% (16.3%)。向こう半年では「求職が増える」との回答は 21.6% (18.7%)。「求職が減る」は 11.9% (12.5%) となった。向こう 1 年間のインフレ見通しは 4.7% (前月 4.6%) となった。



出所：Bloomberg

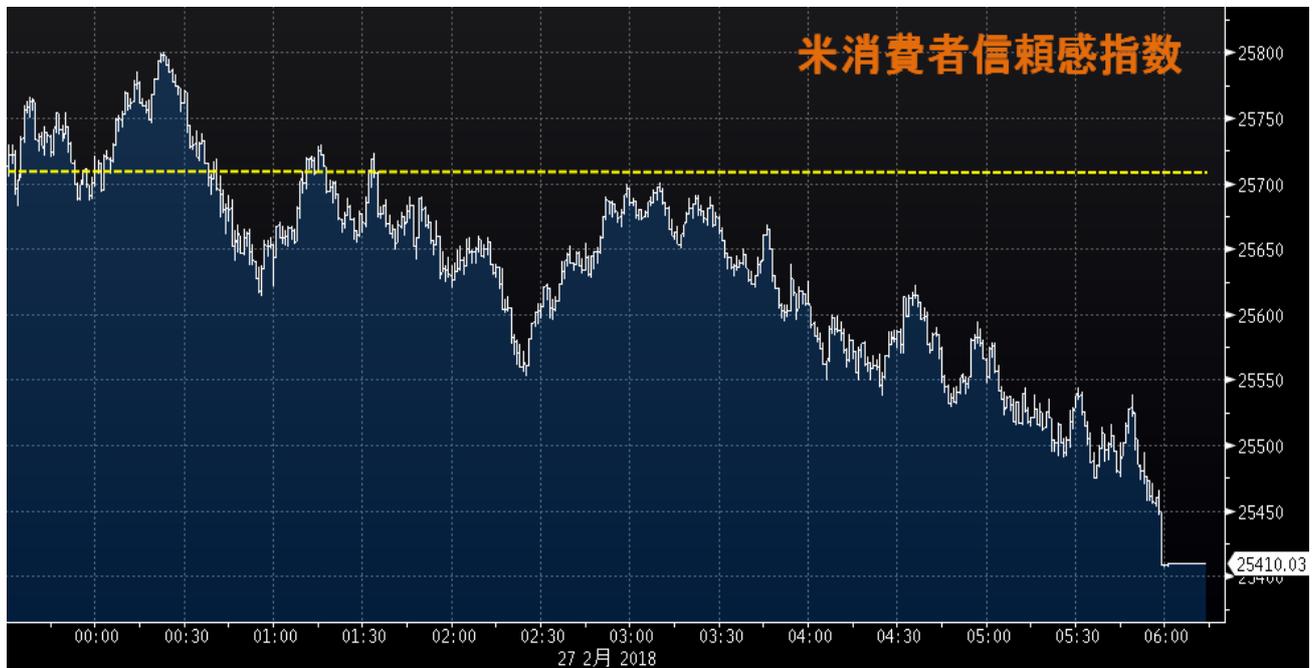
パウエル米 FRB 議長、就任後初めての議会証言

パウエル FRB 議長

- ・ FOMC はリスクおおむね均衡と判断、インフレ注視
 - ・ 財政政策の刺激効果高まる、国外需要はより堅調
 - ・ 米経済見通しは力強い、インフレは2%に上昇へ
 - ・ 長期的に米国債が大半のバランスシートが望ましい
-
- ・ インフレの積み上がり、金融の不均衡に警戒必要
 - ・ 12月 FOMC 以降のデータ、経済の強化を示唆
 - ・ リセッションのリスクは現時点で高くない
 - ・ 3月 FOMC の経済予測、予断は持ちたくない
-
- ・ 持続可能な財政軌道の維持は非常に重要
 - ・ 債務上限、時宜を得た引き上げであるべきだ
 - ・ 2%のインフレ目標、利下げ余地を設ける目的で設定
 - ・ 完全雇用、失業率で4%台前半
-
- ・ 労働力の成長、移民が寄与
 - ・ 2%のインフレ目標、強い決意で取り組んでいる
 - ・ 米財政、持続可能な軌道に乗っていない
 - ・ 株式市場は経済ではない、経済の一要素ではある
-
- ・ 現在の経済には両面のリスクがみられる
 - ・ 利上げペースで米当局は出遅れていない
 - ・ 現在のイールドカーブに問題みられず
 - ・ 米経済はここしばらく最良の状態にある

米主要株価は反落となった

米株式市場は、パウエルFRB議長の議会証言を受けて、追加利上げのペース加速への警戒感が強まり、幅広い銘柄で売りが優勢となった。また、前日まで3営業日続伸したことを受け、利益確定の売りも出ていた。ダウ平均株価は、序盤プラス圏で推移する場面もあったが、FRB議長の議会証言後は終盤まで軟調な動きが続いた。



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	消費者サービス	-2.33%	1	ウォルト・ディズニー	-4.50%
2	素材	-2.30%	2	メルク	-2.39%
3	通信サービス	-2.14%	3	ナイキ	-2.33%
4	消費財	-1.60%	4	DowDupont	-2.30%
5	石油・ガス	-1.20%	5	ベライゾン	-2.14%

出所：データを基にSBILMが作成

ドルは大半の主要通貨に対して上昇

NY 市場では、注目されたパウエル FRB 議長の就任以来初めてとなる議会証言で、「自身の米経済見通しは 12 月以降に強まっており、当局は利上げ軌道の見直しを検討するのが妥当かもしれない」と発言したことを受けて、利上げペースの加速が意識され、ドルは主要通貨に対して堅調な動きとなった。



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。