

NY マーケットレポート (2018年8月23日)

2018年 8月23日 (木)

アジア主要株価	終値	前日比	年初来%	外国為替	終値	高値	安値
日経平均	22410.82	+48.27	-1.56%	USD/JPY	111.21	111.31	110.52
ハンセン指数	27790.46	-137.12	-7.11%	EUR/JPY	128.37	128.77	127.92
上海総合	2724.62	+10.02	-17.61%	GBP/JPY	142.52	143.02	142.43
韓国総合	2282.60	+9.27	-7.49%	AUD/JPY	80.62	81.33	80.58
豪ASX200	6244.37	-21.61	2.96%	NZD/JPY	73.80	74.14	73.79
インドSENSEX	38336.76	+51.01	12.57%	EUR/USD	1.1542	1.1599	1.1530

欧州主要株価	終値	前日比	年初来%	コモディティ	終値	前日比	年初来%
英FT100	7563.22	-11.02	-1.62%	NY GOLD	1194.00	-9.30	-9.0%
仏CAC40	5419.33	-1.28	2.01%	NY 原油	67.83	-0.03	11.5%
独DAX	12365.58	-20.12	-4.27%	CBOTコーン	361.00	-5.75	-1.1%
スペインIBX35	9567.30	-12.90	-4.75%	CRB指数	190.50	-0.622	-1.7%
イタリアFTSE MIB	20608.51	-91.19	-5.70%	ドル指数先物	95.639	+0.493	3.8%
南ア全株指数	58204.72	+78.77	-2.18%	VIX指数	12.41	+0.16	12.4%

米国主要株価	終値	前日比	年初来%	Crypto Currency	本日	前日
米ダウ平均	25656.98	-76.62	3.79%	CBOE Bitcoin(先物・期近)	6405	6315
S&P500	2856.98	-4.84	6.86%	CME Bitcoin(先物・期近)	6400	6325
NASDAQ	7878.46	-10.64	14.12%	Ripple (BSTP)	0.320	0.316
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%	Ethereum (BSTP)	273.45	267.88
トロント総合	16326.79	-20.55	0.73%	Bitcoin Cash	518.41	516.36
ボルサ指数	49749.56	-130.78	0.80%	*USD 6:00時点		
ボベスパ指数	75633.77	-1268.52	-1.01%	日本国債利回り	本日	前日

*一部暫定値

8/24 経済指標スケジュール

08:30	【日本】7月消費者物価指数
09:50	【日本】7月企業向けサービス価格指数
14:00	【シンガポール】7月鉱工業生産
15:00	【ノルウェー】失業率
15:00	【ドイツ】2Q GDP
15:00	【ドイツ】2Q個人消費
16:30	【スウェーデン】7月生産者物価指数
17:00	【ポーランド】失業率
17:30	【英国】7月BBA住宅ローン承認件数
21:30	【米国】7月耐久財受注
22:00	【メキシコ】2Q GDP
22:00	【メキシコ】2Q 経常収支
22:00	【メキシコ】7月経済活動IGAE

2年債	-0.116%	-0.116%
5年債	-0.077%	-0.078%
10年債	0.100%	0.099%
30年債	0.848%	0.855%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.339%	0.344%
英国 10年債	1.270%	1.272%
フランス 10年債	0.680%	0.690%
米国債利回り		
2年債	2.616%	2.591%
3年債	2.673%	2.651%
5年債	2.723%	2.704%
7年債	2.780%	2.765%
10年債	2.826%	2.819%
30年債	2.980%	2.984%

8/24 主要会議・講演・その他予定

・パウエルFRB議長 講演 (ジャクソンホール)

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新築住宅販売が冴えない結果となり、反応は限定的だった。むしろ、米国の追加利上げに対する期待感などを背景に、ドルを買って円を売る動きが優勢となっており、ドルは主要通貨に対して堅調な動きとなった。特に、金利差拡大観測から円に対して堅調な動きが続いており、ドル/円は 8/15 以来の高値を付ける動きとなった。また、ユーロ/円も序盤から堅調な動きとなり、8/9 以来の高値を付ける動きとなった。ドルは堅調な動きが続いたが、米株価下落などが影響し、クロス円は引けにかけて上値の重い動きとなった。米株式市場は、貿易摩擦激化への懸念を背景に、ダウ平均株価は続落、ナスダックは 6 営業日ぶりの反落となった。

主要な米経済指標結果

新規失業保険申請件数 21.0 万件（予想 21.5 万件・前回 21.2 万件）

失業保険継続受給者数 172.7 万人（予想 173.5 万人・前回 172.1 万人⇒172.9 万人）

米失業保険申請件数は、前週比-0.2 万件の 21.0 万件と 3 週連続の減少となった。申請件数の 4 週移動平均は、前週比-1750 件の 21 万 3750 件。また、集計が 1 週遅れる失業保険受給者数は、前週比-0.2 万人の 172.7 万人となった。受給者総数の 4 週移動平均は、前週比-0.5 万人の 173 万 5500 人だった。受給者比率は、前週から変わらずの 1.2% だった。



出所：Bloomberg

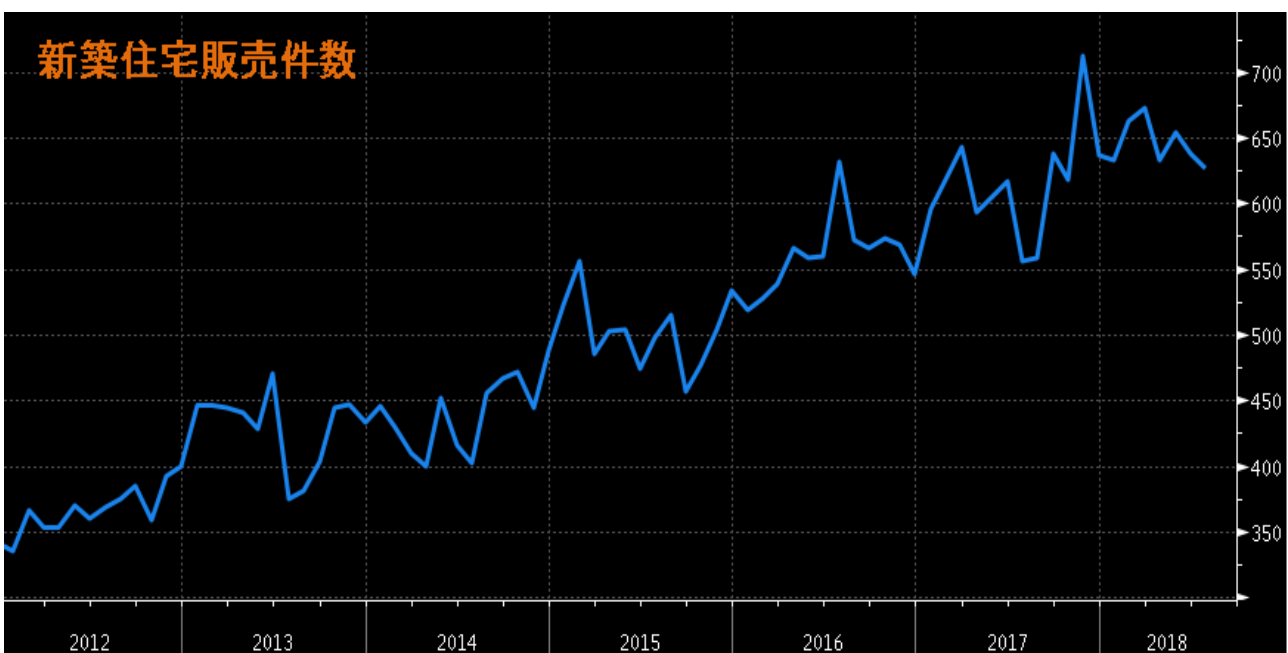


出所：Bloomberg

7月新築住宅販売件数 62.7万件（予想 64.8万件・前回 63.1万件⇒63.8万件）

7月新築住宅販売件数（前月比） -1.7%（予想 2.7%・前回 -5.3%⇒-2.4%）

7月の米新築住宅販売件数は、年率換算で前月比-1.7%となり、市場予想を下回る結果となった。前年比では+12.8%だった。市場の住宅在庫は、+2.0%の30.9万件と2009年3月以来の高水準、販売に対する在庫率は5.9ヵ月と前月から+0.2ヵ月となり、適正水準とされる6.0ヵ月を下回った。地域別では、北東部が-52.3%と2015年1月以来の低水準、南部が-3.3%、中西部は+9.9%、西部は+10.9%だった。



出所：Bloomberg

要人発言

カプラン・ダラス連銀総裁～テレビのインタビュー

- ・われわれの仕事は政治的影響に関係なく、金融政策と監督に関する決定を下すことだ
- ・私がそうすべきだと思うように当局が金利を中立水準に引き上げるなら、向こう9ヵ月から12ヵ月で3-4回の利上げが必要になるという意味だと思う
- ・利上げでFF金利の誘導目標を2.5-2.75%に引き上げた場合でも、10年債利回りを下回ると予想。
- ・フラット化し始めており、それについて私は注視していく。逆イールドを発生させずに中立水準に利上げできると期待している

ボスティック・アトランタ連銀総裁～ウェブのコメント

- ・2020年まで政策金利の引き上げが続くと市場は予想しているように見え、FOMCが中期的に方向転換を行う必要が出てくると市場が予測している兆候はない
- ・20年を過ぎた段階で、市場が見込む政策軌道はフラット化する。これは、非常に漸進的なペースでの引き締めが、今後2年で最も起こりそうな結果だと市場参加者が全体として考えている証拠と私は受け止めている
- ・予見可能な将来に景気動向がFOMCに利下げを促すと市場が考えている兆候をイールドカーブが示唆しているとは解釈していない。これは私自身の経済見通しとも一致する

トランプ米大統領～議員との討論会

- ・外国投資リスク審査近代化法=FIRRMAで米国は世界でおそらく最高のセーフガードを備えた
- ・高度の技術が盗まれることはもうない

トランプ米大統領～インタビュー

- ・もし自分が弾劾されるようなことになれば、市場は崩壊すると思う。国民全員が非常に貧しくなる。弾劾されなければそれとは逆の、信じられないような数字が実現するのだから

ダウ平均は続落、ナスダック 6 営業日ぶりの反落

米株式市場は、米国と中国が互いに制裁関税の第 2 弾を発動したことで貿易摩擦激化への懸念が強まり、主要株価は軟調な動きとなった。また、原油価格の下落を受けて石油株が売られたことも圧迫要因となった。ダウ平均株価は、下落して始まったものの、一時プラス圏までの反発が見られたもののその後は再び軟調な動きが続き、続落となった。一方、ナスダックは底固い動きが続いたものの、終盤に再びマイナス圏に落ち込み、6 営業日ぶりの反落となった。



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	素材	-0.95%	1	キャタピラー	-2.03%
2	資本財	-0.91%	2	GS	-1.25%
3	石油・ガス	-0.85%	3	エクソン	-1.10%
4	金融	-0.36%	4	DowDuPont	-0.95%
5	消費者サービス	-0.17%	5	マクドナルド	-0.93%

出所：データを基に SBILM が作成

ドル/円は主要通貨に対して堅調な動き

米新築住宅販売が冴えない結果となったものの、米国の追加利上げに対する期待感などを背景に、ドルは主要通貨に対して堅調な動きとなったことから、反応は限定的に。特に、金利差拡大観測から円に対して堅調な動きとなり、ドル/円は 8/15 以来の高値を付ける動きとなり、終盤まで堅調な動きが続いた。また、ユーロ/円も序盤から堅調な動きとなり、8/9 以来の高値を付ける動きとなった。しかし、イタリアの首相が、移民問題を解決しなければ、来年度の EU 予算にイタリアは拠出しないと発言したとの報道を受けてユーロ売りとなり、ドルや円などに対して下落に転じた。



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。