

NY マーケットレポート (2018年10月1日)

2018年10月1日 (月)

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	24245.76	+125.72	6.50%	USD/JPY	113.96	114.06	113.70
ハンセン指数	休場			EUR/JPY	131.93	132.46	131.74
上海総合	休場			GBP/JPY	148.60	149.37	148.18
韓国総合	2338.88	-4.19	-5.21%	AUD/JPY	82.33	82.40	82.07
豪ASX200	6172.26	-35.30	1.77%	NZD/JPY	75.38	75.52	75.21
インドSENSEX	36526.14	+299.00	7.25%	EUR/USD	1.1577	1.1623	1.1564

*中国市場は国慶節で休場

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	7495.67	-14.53	-2.50%	NY GOLD	1191.70	-4.50	-8.7%
仏CAC40	5506.82	+13.33	3.66%	NY 原油	75.30	+2.05	24.8%
独DAX	12339.03	+92.30	-4.48%	CBOTコーン	365.75	+9.50	4.3%
スペインIBX35	9407.00	+17.80	-6.34%	CRB指数	197.79	+2.628	2.0%
イタリアFTSE MIB	20609.99	-101.71	-5.69%	ドル指数先物	95.309	+0.177	3.5%
南ア全株指数	55789.75	+81.28	-6.24%	VIX指数	12.00	-0.12	8.7%

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	26651.21	+192.90	7.82%	CBOE Bitcoin(先物・期近)	6525	6615
S&P500	2924.59	+10.61	9.39%	CME Bitcoin(先物・期近)	6520	6605
NASDAQ	8037.30	-9.05	16.43%	Ripple (BSTP)	0.581	0.533
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%	Ethereum (BSTP)	229.24	220.64
トロント総合	16104.43	+31.29	-0.65%	Bitcoin Cash	529.76	539.07
ボルサ指数	49841.47	+337.31	0.99%			
ボベスパ指数	78623.66	-718.77	2.91%			

*USD 6:00時点

*一部暫定値

10/2 経済指標スケジュール

08:50	【日本】9月マネタリーベース
13:30	【オーストラリア】政策金利発表
14:00	【日本】9月消費者態度指数
15:00	【英国】9月ネーションワイド住宅価格
17:30	【香港】8月小売売上高
17:30	【英国】9月建設業PMI
18:00	【欧州】8月生産者物価指数
22:00	【シンガポール】9月購買部景気指数
22:00	【シンガポール】9月電子産業指数
22:00	【メキシコ】8月景気先行指数
22:00	【メキシコ】9月外貨準備高
02:00	【ニュージーランド】9月QV住宅価格

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.111%	-0.111%
5年債	-0.063%	-0.067%
10年債	0.136%	0.130%
30年債	0.931%	0.908%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.471%	0.470%
英国10年債	1.588%	1.573%
フランス10年債	0.810%	0.800%
米国債利回り		
2年債	2.819%	2.819%
3年債	2.886%	2.883%
5年債	2.961%	2.953%
7年債	3.035%	3.020%
10年債	3.084%	3.061%
30年債	3.234%	3.206%

10/2 主要会議・講演・その他予定

- ・EU経済・財務相理事会
- ・クオールズFRB副議長 議会証言
- ・パウエルFRB議長 講演

NY 市場レポート

◀ NY 市場概況 ▶

NY 市場では、米国とカナダの NAFTA（北米自由貿易協定）再交渉が合意したことを材料に、米株価が大幅に上昇となったことが好感され、ドル円・クロス円は序盤から堅調な動きとなった。特に、ドル円は一時 114.06 円まで上昇し、11 ヶ月ぶりの高値を付けた。一方、英国の EU 離脱問題が進展するとの期待感を背景に、ポンドは主要通貨に対して急上昇となった。これを受けて、ユーロもドルや円に対して堅調となる場面もあったが、イタリアの予算案を巡る不透明感を背景に、その後は上値の重い動きが続いた。

主要な米経済指標結果

9 月 ISM 製造業景況指数 59.8（予想 60.0・前回 61.3）

9 月の米 ISM 製造業景況指数は、市場予想を下回り、前月から 1.5 ポイント低下し、14 年ぶりの高水準だった前月から低下した。堅調な需要と減税が支える中で製造業はなお堅調なペースで拡大しているものの、活況を呈する状況ではなくなったことが示唆された。ただ、製造業の景気拡大・縮小の分岐点となる 50 は 25 ヶ月連続で上回った。新規受注は 61.8（前月 65.1）、在庫が 53.3（55.4）、仕入れ価格が 66.9（72.1）、生産は 63.9（63.3）、雇用は 58.8（58.5）。9 月は 18 業種中 15 業種が景況拡大を報告、業況縮小は 1 業種だった。



出所：Bloomberg

8月建設支出（前月比） 0.1%（予想 0.4%・前回 0.1%⇒0.2%）

8月の米建設支出は、年率換算で前月比+0.1%の1兆3184億8500万ドルと市場予想を下回った。前年比では+6.5%だった。民間の建設支出は-0.5%の1兆17億4900万ドル、前年比では+4.4%となり、住宅建設が前月比-0.7%の5488億9200万ドル、住宅以外の建設は-0.2%の4528億5800万ドルだった。連邦政府など公共部門の建設支出は前月比+2.0%の3167億3600万ドル。



出所：Bloomberg

要人発言

ローゼングレン・ボストン連銀総裁

- ・米金融政策当局は「やや抑制的な」領域に入るまで利上げを継続するべきだ
- ・インフレ圧力を含め経済の不均衡は今後も積み上がるだろう
- ・潜在成長率を上回る GDP 見通しに完全に整合する
- ・GDP 見通しでは労働市場はさらに引き締まり、インフレは2%上昇を若干上回る

カシュカリ・ミネアポリス連銀総裁

- ・債券市場は黄色信号を点滅させている、この先は全てがバラ色ではないかもしれないということだ
- ・長期金利にあまり動きは見られない、債券市場が今後数年間の米経済成長が非常に力強いものであるかどうか確信を持ってないと述べているものだ
- ・私は米金融政策当局が過度の利上げを行っていないかどうか見極めようとしている

米ダウ平均株価は3営業日続伸、ナスダックは小幅反落

米株式市場は、米国とカナダが NAFTA（北米自由貿易協定）再交渉で合意したことが好感され、主要株価は序盤から堅調な動きとなった。また、原油価格が大きく上昇したことで、石油セクターが買われたことも下支え要因となった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前日比 279 ドル高まで上昇した。しかし、終盤にかけて上げ幅を縮小し、192 ドル高で終了した。一方、ナスダックは終盤にマイナス圏まで下落となり、小幅安となった。



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	1.46%	1	ボーイング	2.79%
2	石油・ガス	1.40%	2	シェブロン	1.73%
3	ヘルスケア	1.03%	3	アメリカンエキスプレス	1.32%
4	通信サービス	0.84%	4	IBM	1.18%
5	素材	0.79%	5	ユナイテッドH	1.15%

出所：データを基に SBILM が作成

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。