

NY マーケットレポート (2018年10月2日)

2018年10月2日 (火)

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	24270.62	+24.86	6.61%	USD/JPY	113.64	114.01	113.53
ハンセン指数	27126.38	-662.14	-9.33%	EUR/JPY	131.25	132.00	130.72
上海総合	休場			GBP/JPY	147.51	148.73	147.20
韓国総合	2309.57	-29.31	-6.40%	AUD/JPY	81.69	82.47	81.38
豪ASX200	6126.21	-46.05	1.01%	NZD/JPY	74.94	75.37	74.71
インドSENSEX	休場			EUR/USD	1.1549	1.1580	1.1505

*中国市場は国慶節、インド市場はMahatma Gandhi Birthday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	7474.55	-21.12	-2.77%	NY GOLD	1207.00	+15.30	-7.6%
仏CAC40	5467.89	-38.93	2.92%	NY 原油	75.23	-0.07	24.3%
独DAX	12287.58	-51.45	-4.88%	CBOTコーン	367.50	+1.75	4.8%
スペインIBX35	9305.50	-101.50	-7.35%	CRB指数	199.97	+2.182	3.2%
イタリアFTSE MIB	20562.31	-47.68	-5.91%	ドル指数先物	95.489	+0.191	3.7%
南ア全株指数	55472.57	-317.18	-6.78%	VIX指数	12.05	+0.05	9.2%

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	26773.94	+122.73	8.31%	CBOE Bitcoin(先物・期近)	6515	6525
S&P500	2923.43	-1.16	9.34%	CME Bitcoin(先物・期近)	6505	6520
NASDAQ	7999.55	-37.76	15.88%	Ripple (BSTP)	0.545	0.581
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%	Ethereum (BSTP)	225.68	229.24
トロント総合	16017.23	-87.20	-1.18%	Bitcoin Cash	537.37	529.76
ボルサ指数	49376.50	-464.97	0.04%	*USD 6:00時点		
ボベスパ指数	81612.28	+2988.63	6.82%	日本国債利回り	本日	前日

*一部暫定値

10/3 経済指標スケジュール

08:01	【英国】9月BRC店頭価格指数
09:00	【ニュージーランド】9月ANZ商品価格指数
09:30	【日本】9月サービス業PMI
10:00	【オーストラリア】8月住宅建設許可件数
16:00	【トルコ】9月生産者物価指数
16:00	【トルコ】9月消費者物価指数
16:50	~ 17:30
	【仏】【独】【欧】【英】9月サービス業PMI
18:00	【欧州】8月小売売上高
19:00	【ポーランド】政策金利発表(時間不確定)
20:00	【米国】MBA住宅ローン申請指数
21:15	【米国】9月ADP雇用統計
22:45	【米国】9月非製造業PMI
23:00	【米国】9月ISM非製造業景況指数
23:30	【米国】EIA原油在庫

2年債	-0.111%	-0.111%
5年債	-0.065%	-0.063%
10年債	0.130%	0.136%
30年債	0.920%	0.931%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.422%	0.471%
英国10年債	1.528%	1.588%
フランス10年債	0.790%	0.810%
米国債利回り		
2年債	2.811%	2.819%
3年債	2.883%	2.886%
5年債	2.951%	2.961%
7年債	3.020%	3.035%
10年債	3.063%	3.084%
30年債	3.217%	3.234%

10/3 主要会議・講演・その他予定

- ・シカゴ連銀総裁 講演
- ・リッチモンド連銀総裁 講演
- ・クリーブランド連銀総裁 講演

NY 市場レポート

◀ NY 市場概況 ▶

NY 市場では、米国の主要な経済指標の発表がなく新規材料に乏しい中、米長期金利の低下に伴いドルを売って円を買う動きが先行した。その後、ダウ平均株価の上昇が好感されたものの、イタリアの財政不安を背景に、相対的に安全な通貨とされる円が買われ、ドル円・クロス円は上値の重い動きとなった。ユーロは、イタリア連立政権の「同盟」の複数の有力議員の発言に加え、イタリアの財政悪化への不安を背景に、引き続き上値の重い動きが続いた。

要人発言

パウエル FRB 議長

- ・ 緩やかな利上げ継続支持
- ・ 失業率低下で物価が急激に上昇し、積極的な利上げを余儀なくされることにはならない
- ・ 賃金上昇は確認された価格インフレや労働生産性の伸びとおおむね整合しているため、労働市場の過熱を示唆しない
- ・ 賃金の伸び率上昇だけでは、必ずしもインフレ的とは言えない
- ・ 低インフレの定着と極めて低い失業率という歴史的にまれな組み合わせは、類いまれな時代が続いていることの証しだ
- ・ 金利の緩やかな正常化を継続する当局の政策は、類いまれな時代に不可避なリスクを均衡することで、現在の景気拡大を引き延ばしつつ、最大限の雇用と低く安定したインフレを維持しようとする当局の取り組みの表れだ

カプラン・ダラス連銀総裁

- ・ 12 月の追加利上げに違和感ない
- ・ 来年は 2 回の利上げがベースケースだとみている
- ・ 中立金利の正確な水準はもともと不確実なものだ
- ・ 現在の推定値は 2.5-2.75%だ
- ・ その水準に到達するためには 2-3 回の追加利上げが必要なようだ
- ・ 中立金利水準に達したらどうするかについて全ての選択肢を残しておきたい
- ・ 税制改革などが寄与し米経済にとって「良い年」になる

- ・米 GDP 伸び率は今年が 3%、来年は 2.75%、再来年は 2.5%になる見込み
- ・米政府の債務の伸びによる追い風は向かい風に代わる可能性がある
- ・失業率はさらに低下する可能性
- ・中国との貿易問題に米国がいま取り組むのは正しい
- ・近年、石油の供給において脆弱な世界的均衡が生じている
- ・石油の価格リスクは上振れ方向
- ・ダラス連銀はダイナミクスを非常に慎重に注視している

クドロー国家経済会議（NEC）委員長

- ・米国と中国は貿易協議を続ける
- ・中国の対応は不十分だが、だからといって今後常に不十分だというわけではない
- ・中国は米国の知的財産を盗むのをやめ、関税および非関税の貿易障壁を排除しなければならない

米ダウ平均株価は 4 営業日続伸、ナスダックの続落

米株式市場は、米国とカナダの通商協定の合意を受けて貿易摩擦への懸念が後退したことが引き続き材料視され、ダウ平均株価は 4 営業日続伸し、終値ベースの最高値を更新した。一方、ハイテク株中心のナスダックは、利用者の情報流出問題を抱える大手交流サイトの下落が影響して続落となった。



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	資本財	1.20%	1	インテル	3.55%
2	通信サービス	1.08%	2	キャタピラー	1.67%
3	テクノロジー	0.69%	3	3M	1.66%
4	石油・ガス	0.48%	4	ウォルグリーンBA	1.42%
5	ヘルスケア	0.47%	5	ウォルトディズニー	1.22%

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。