

NY マーケットレポート (2018年10月3日)

2018年10月3日 (水)

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	24110.96	-159.66	5.91%	USD/JPY	114.46	114.47	113.53
ハンセン指数	27091.26	-35.12	-9.45%	EUR/JPY	131.69	131.97	130.97
上海総合	休 場			GBP/JPY	148.38	148.59	147.28
韓国総合	2309.57	-29.31	-6.40%	AUD/JPY	81.43	81.92	81.33
豪ASX200	6146.07	+19.86	1.33%	NZD/JPY	74.68	75.06	74.54
インドSENSEX	35975.63	-550.51	5.63%	EUR/USD	1.1505	1.1594	1.1500

*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	7510.28	+35.73	-2.31%	NY GOLD	1202.90	-4.10	-8.0%
仏CAC40	5491.40	+23.51	3.37%	NY 原油	76.41	+1.18	26.1%
独DAX	休 場			CBOTコーン	364.75	-2.75	4.0%
スペインIBX35	9361.10	+55.60	-6.80%	CRB指数	201.23	+1.259	3.8%
イタリアFTSE MIB	20736.01	+173.70	-5.11%	ドル指数先物	95.762	+0.255	4.0%
南ア全株指数	55171.50	-301.07	-7.28%	VIX指数	11.61	-0.44	5.2%

*ドイツ市場はドイツ統一記念日で休場

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	26828.39	+54.45	8.53%	CBOE Bitcoin(先物・期近)	6420	6515
S&P500	2925.51	+2.08	9.42%	CME Bitcoin(先物・期近)	6410	6505
NASDAQ	8025.08	+25.54	16.25%	Ripple (BSTP)	0.519	0.545
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%	Ethereum (BSTP)	217.17	225.68
トロント総合	16072.05	+54.83	-0.85%	Bitcoin Cash	516.37	537.37
ボルサ指数	49005.35	-371.14	-0.71%			
ボベスパ指数	83273.40	+1661.12	8.99%			

*USD 6:00時点

*一部暫定値

10/4 経済指標スケジュール	
08:50	【日本】9月対内外証券投資
09:30	【香港】9月購買部景気指数
10:30	【オーストラリア】8月貿易収支
17:00	【英国】9月新車登録台数
20:00	【南アフリカ】8月電力消費・発電
20:30	【米国】9月チャレンジャー人員削減数
21:30	【米国】新規失業保険申請件数
21:30	【米国】失業保険継続受給者数
22:00	【メキシコ】9月消費者信頼感指数
23:00	【米国】8月耐久財受注
23:00	【米国】8月製造業受注指数
23:00	【カナダ】9月Ivey購買部協会指数
23:30	【米国】EIA天然ガス貯蔵量
03:00	【メキシコ】政策金利発表

日本国債利回り	本 日	前 日
2年債	-0.112%	-0.111%
5年債	-0.065%	-0.065%
10年債	0.141%	0.130%
30年債	0.920%	0.920%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.475%	0.422%
英国 10年債	1.575%	1.528%
フランス 10年債	0.820%	0.790%
米国債利回り		
2年債	2.872%	2.811%
3年債	2.964%	2.883%
5年債	3.045%	2.951%
7年債	3.130%	3.020%
10年債	3.181%	3.063%
30年債	3.335%	3.217%

10/4 主要会議・講演・その他予定

・クォールズFRB副議長 講演

NY 市場レポート

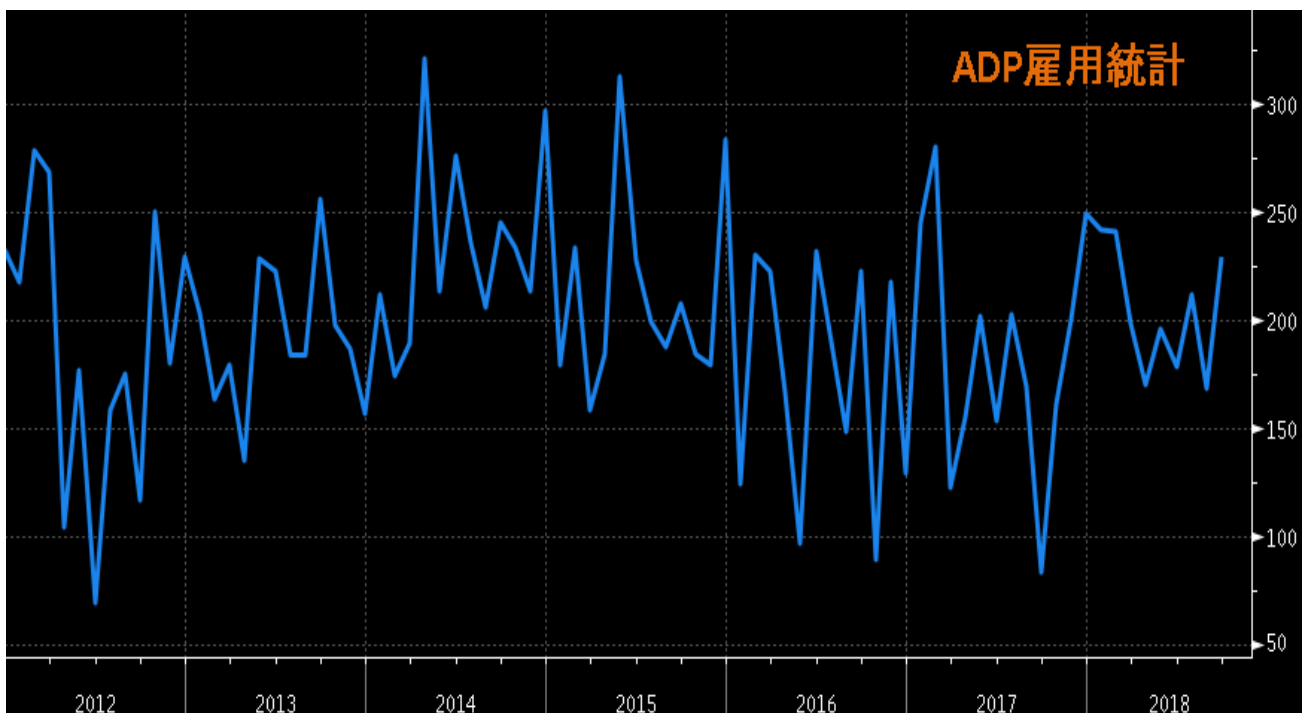
◀ NY 市場概況 ▶

NY 市場では、序盤に発表された ADP 雇用統計、ISM 非製造業景況指数が良好な結果となったことを受けて、ドル買いが先行した。さらに、米主要株価が堅調な動きとなったことや、米国債利回りが上昇したことも加わり、ドル買い・円売りが優勢となった。特に、ドル/円は 114.47 まで上昇し、昨年 11/6 以来の高値を付けた。米株式市場では、ダウ平均株価が 5 営業日続伸となり、連日の最高値更新となった。

主要な米経済指標結果

9 月 ADP 雇用統計 23.0 万人（予想 18.5 万人・前回 16.3 万人⇒16.8 万人）

9 月の米 ADP 雇用統計では、雇用者数の伸びが 7 ヶ月ぶりの大幅増加となった。建設業や製造業を含む財生産部門の雇用は+4.6 万人（+2.3 万人）と 3 月以来の大幅増。サービス業の雇用は+18.5 万人（前月 14.5 万人）と 1 月以来の大幅な伸び。業種別では、建設業は+3.4 万人、製造業は+0.7 万人、専門職・ビジネスサービス部門は+7.0 万人、娯楽・ホスピタリティー関連は+1.6 万人となった。従業員が 500 人以上の大企業の雇用者は+7.5 万人、50-499 人の中堅企業では+9.9 万人、49 人以下の小企業では+5.6 万人。



出所：Bloomberg

9月 ISM 非製造業景況指数 61.6 (予想 58.0・前回 58.5)

9月の米 ISM 非製造業景況指数は、市場予想を上回り、前月から 3.1 ポイント上昇となり、21 年ぶりの高水準となった。事業活動が 65.2 (前月 60.7)、新規受注が 61.6 (60.4)、雇用が 62.4 (56.7)、仕入れ価格が 64.2 (62.8)、在庫が 54.3 (53.5) となった。9月は 17 業種が景況拡大、業況縮小した業種はなかったと報告。



出所：Bloomberg

要人発言

パウエル FRB 議長

- ・ 景気拡大はかなりの期間継続の可能性
- ・ 経済の現状に非常に満足
- ・ 金利は依然緩和的だ
- ・ 中立的な水準へとわれわれは徐々に向かっている
- ・ われわれは中立を超えるかもしれない。恐らく中立金利まで長い道のりがある
- ・ 動きが速過ぎるのと遅過ぎるののでうまく進める現実的なやり方は緩やかに動くことだ
- ・ 極めて前向きな経済条件が整っており、失業率を低く保ち、インフレ率を目標水準にとどめようと努めている
- ・ この景気サイクルが長期間続くことは不可能だと考える理由はない

ブレイナード FRB 理事

- ・ドルの世界準備通貨としての役割は極めて強大であり、世界にとって今後も非常に重要な準備通貨であり続けるための多くの要因が実際に存在していると思う
 - ・われわれはわれわれの金融システムが回復力と流動性を有し、開かれているようにし続ける必要がある
 - ・これらが、ドルの国際的地位が引き続き非常に力強くあるための基盤だ
 - ・世界金融システムにおける米金融市場の役割だけでなく、世界経済における米経済の役割を考慮すれば、ドルは特定の技術を上回る
- * 米経済見通しや金融政策については言及しなかった

バーキン・リッチモンド連銀総裁

- ・成長は底堅く、失業率も低い。インフレは目標水準にある
 - ・貿易摩擦によって数カ月前と比べて神経質さが増している
 - ・信頼感が続くかどうかを明確に示唆する指標だ。今後の方向性に良い感触を得ない限り、企業は将来に投資することはないだろう。個人的な見解では、これこそが現在の関税措置を巡る議論がもたらしている大きな課題だ
 - ・長短金利の差が縮小しており、市場が見通しに対して信頼を失いつつあることを示している可能性がある
 - ・過去にはリセッションに突入する前に逆イールドが発生することが多かった
- * 金融政策の具体的な見通しは言及しなかった

米ダウ平均株価は5営業日続伸、連日の最高値更新

米株式市場は、イタリア財政への過度な懸念が和らいだことや、米経済指標が市場予想を上回ったことで、米景気は堅調との見方から買いが優勢となった。米長期金利の上昇で収益改善の思惑から金融株が堅調となっ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177ドル高まで上昇した。その後はやや上げ幅を縮小したものの、5営業日続伸となり連日の最高値も更新した。一方、ハイテク株中心のナスダックは、3営業日ぶりに上昇した。



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	1.00%	1	キャタピラー	2.20%
2	テクノロジー	0.52%	2	ボーイング	1.53%
3	金融	0.35%	3	インテル	1.37%
4	石油・ガス	0.12%	4	ファイザー	1.33%
	消費財	-1.05%		P&G	-1.58%

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。