

NY マーケットレポート (2018年10月25日)

2018年10月25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	21268.73	-822.45	-6.57%	USD/JPY	112.45	112.67	111.82
ハンセン指数	24994.46	-255.32	-16.46%	EUR/JPY	127.87	128.43	127.50
上海総合	2603.80	+0.50	-21.27%	GBP/JPY	144.10	145.03	144.05
韓国総合	2063.30	-34.28	-16.38%	AUD/JPY	79.62	79.80	79.00
豪ASX200	5664.07	-164.96	-6.61%	NZD/JPY	73.33	73.57	72.82
インドSENSEX	33690.09	-343.87	-1.08%	EUR/USD	1.1371	1.1432	1.1356

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	7004.10	+41.12	-8.89%	NY GOLD	1232.40	+1.30	-5.4%
仏CAC40	5032.30	+79.21	-5.28%	NY 原油	67.33	+0.51	14.5%
独DAX	11307.12	+115.49	-12.47%	CBOTコーン	361.00	-7.25	2.9%
スペインIBX35	8785.20	+107.80	-12.53%	CRB指数	194.79	+0.324	0.5%
イタリアFTSE MIB	18815.32	+329.86	-13.90%	トル指数先物	96.605	+0.171	4.9%
南ア全株指数	51624.86	+747.52	-13.24%	VIX指数	24.22	-1.01	119.4%

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	24984.55	+401.13	1.07%	CBOE Bitcoin(先物・期近)	6380	6400
S&P500	2705.57	+49.47	1.20%	CME Bitcoin(先物・期近)	6405	6410
NASDAQ	7318.34	+209.94	6.01%	Ripple (BSTP)	0.457	0.466
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%	Ethereum (BSTP)	199.95	204.49
トロント総合	14924.08	+14.95	-7.93%	Bitcoin Cash	446.90	449.33
ボルサ指数	46275.71	+316.68	-6.24%			
ボベスパ指数	84083.51	+1019.95	10.05%			

x一部寄定値

10/26 経済指標スケジュール

08:30	【日本】10月消費者物価指数[東京都区部]
11:30	【シンガポール】3Q失業率
14:00	【シンガポール】9月鉱工業生産
15:45	【フランス】9月生産者物価指数
15:45	【フランス】10月消費者信頼感指数
16:30	【スウェーデン】9月貿易収支
16:30	【スウェーデン】9月小売売上高
21:30	【米国】3Q GDP
21:30	【米国】3Q個人消費
21:30	【米国】3Q GDP価格指数
23:00	【米国】10月ミシガン大学消費者信頼感指数

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.121%	-0.113%
5年債	-0.076%	-0.063%
10年債	0.117%	0.135%
30年債	0.868%	0.896%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.398%	0.396%
英国10年債	1.441%	1.457%
フランス10年債	0.770%	0.770%
米国債利回り		
2年債	2.847%	2.831%
3年債	2.902%	2.883%
5年債	2.960%	2.940%
7年債	3.040%	3.027%
10年債	3.117%	3.103%
30年債	3.343%	3.330%

10/26 主要会議・講演・その他予定

- ・日中首脳会議
- ・ドラギECB総裁 講演
- ・欧州夏時間終了 (28日)
- ・ブラジル大統領選挙 (決選投票) (28日)

NY 市場レポート

◀ NY 市場概況 ▶

NY 市場では、欧米の株価上昇を受けて、ドル円・クロス円は序盤から堅調な動きとなった。ただ、ドラギ ECB 総裁が会見で、来年夏まで利上げはしないとす一方、クラリダ FRB 副議長がある程度の段階的利上げが妥当と発言したことを受けて、金利差拡大を意識したドル買い・ユーロ売りが優勢となり、ユーロは主要通貨に対して軟調な動きとなった。米株式市場では、米企業の好決算が相次いだことから、主要株価は堅調な動きとなり、ダウ平均株価は前日比 401 ドル高で終了し、4 営業日ぶりの大幅反発となった。一方、ハイテク株中心のナスダックも 2.9%を超える大幅反発となった。

主要な米経済指標結果

新規失業保険申請件数 21.5 万件（予想 21.3 万件・前回 21.0 万件）

失業保険継続受給者数 163.6 万人（予想 166.0 万人・前回 164.0 万人）

米失業保険申請件数は、市場予想を上回り、前週比+0.5 万件の 21.5 万件となった。申請件数の 4 週移動平均は、前週比横ばいの 21 万 1750 件。また、集計が 1 週遅れる失業保険継続受給者数は、前週比-0.5 万人の 163.6 万人となり、1973/8/4 までの週以来、約 45 年ぶりの低水準となった。受給者数の 4 週移動平均は、前週比-6750 人の 164 万 6500 人だった。受給者比率は、前週から低下の 1.1%となった。

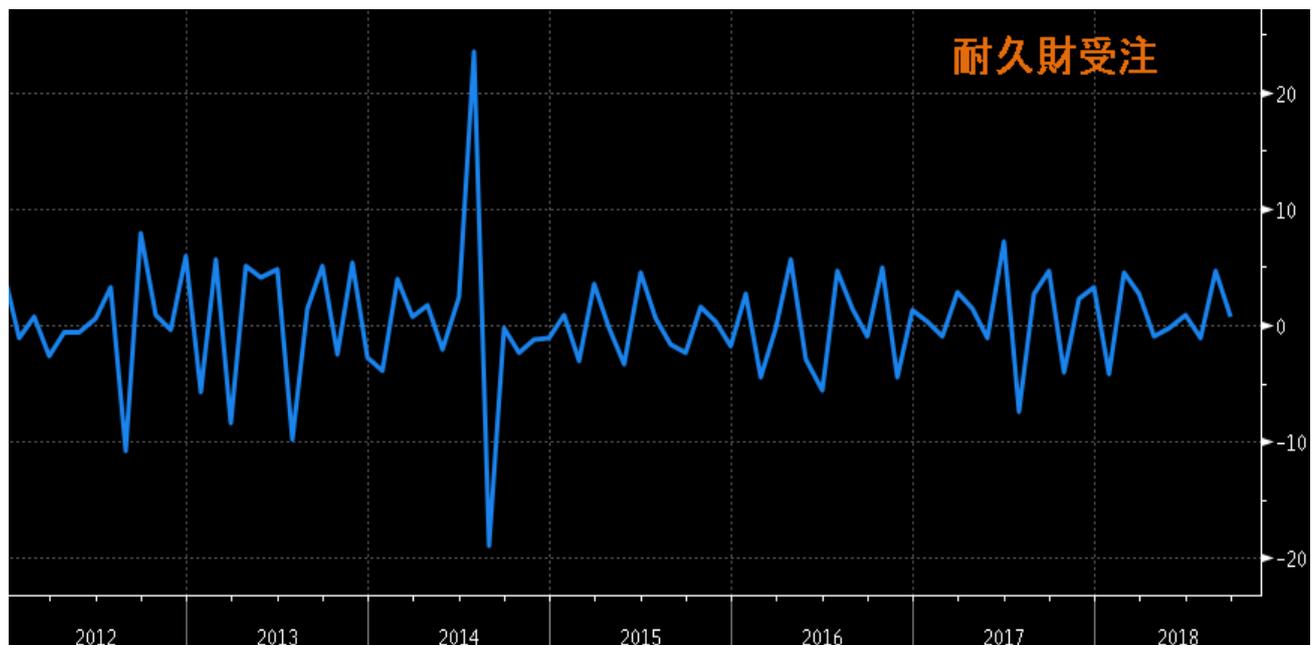


出所：Bloomberg

9月耐久財受注（前月比） 0.8%（予想 -1.5%・前回 4.4%）

9月耐久財受注[除輸送用機器] 0.1%（予想 0.4%・前回 0.0%）

9月の米耐久財受注は、前月比+0.8%の2620億9800万ドルとなり、2ヵ月連続のプラスとなった。輸送機器は+1.9%となり、民間航空機が-17.5%、国防関連の航空機は+119.1%、自動車・同部品は+1.3%となった。輸送機器を除いた受注は+0.1%となり、一次金属が+0.1%、一般機械が+0.8%、電算機・電子製品は横ばい、電機・家電は-0.5%だった。資本財は-4.4%となり、資本財から国防関連を除いた受注は-2.4%。民間設備投資の先行指標となる非国防資本財から航空機を除いたコア受注は-0.1%、国防関連は-14.3%だった。



出所：Bloomberg



出所：Bloomberg

9月中古住宅販売成約（前月比） 0.5%（予想 0.0%・前回 -1.8%）

9月中古住宅販売成約（前年比） -3.4%（予想 -2.6%・前回 -2.5%）

9月の米中古住宅販売仮契約指数は、前月比+0.5%の104.6（2001年=100）となり、3ヵ月ぶりのプラスとなった。地域別では、西部が+4.5%、中西部が+1.2%、南部が-1.4%、北東部が-0.4%。仮契約は通常1-2ヵ月以内に本契約に移行するため、仮契約指数は中古住宅市場の先行指数とされる。



出所：Bloomberg

要人発言

ドラギ ECB 総裁

- ・最近の経済指標、予想したよりもやや弱い
- ・経済成長に対するリスク、依然ほぼ均衡している
- ・インフレは向こう数ヵ月、現在の水準付近で推移へ
- ・ECB、インフレ見通しに対する自信を疑う理由ない
- ・QE 延長、議論していない
- ・貿易に関する不透明、英国の EU 離脱、イタリア、金融市場の不安定という一連の不確実要素がある
- ・今年の成長減速の説明として重要な一つは成長が潜在成長率の水準に戻ったというものだ、2017 年は明らかに上回っていた
- ・一時的なものと恒久的なもの、各国固有のものとユーロ圏全体に広がるもの、消費と投資に実際に影響しているものとそうでないものを区別するのは簡単ではない
- ・イタリア政府に対して冷静になり、借り入れコストを押し上げるような政策をやめるようにと忠告した

クラリダ FRB 副議長

- ・ 緩やかな金利調整の継続が適切
- ・ 金融当局は完全雇用と物価安定という 2 大責務の達成に近づいており、金融政策はなお経済に刺激を加えている
- ・ 政策金利レンジに関してさらにいくらかの漸進的な調整が適切になる可能性が高い
- ・ 金融政策によるバランスが必要なリスクは、現在ではより対称的になっており、下方向リスクへの傾きは弱まっている
- ・ 力強い経済成長と雇用の伸びが継続し、インフレやインフレ期待、さらに金融政策への期待が安定した状況であれば、私としては現在の想定を上回る短期金利引き上げには反対するだろう
- ・ 労働市場には、インフレ圧力を引き起こさずに一段と拡大する余地がある

メスター・クリーブランド連銀総裁

- ・ 米経済は非常に良好に推移
- ・ GDP 伸び率は今年 3%超、来年 2.75-3%と予想
- ・ インフレ率が適切な政策で 2%近くにとどまると予想
- ・ 失業率は来年末までに 3.5%下回る可能性
- ・ 最近の株価動向は投資家の過度の悲観意味せず
- ・ リスクテイクに打撃与える市場混乱から程遠い
- ・ 関税は税金のように作用し、生産性を圧迫

米ダウ平均株価は4営業日ぶりの大幅反発

米株式市場は、米企業の四半期決算が相次いで市場予想を上回ったことから投資家心理が改善し、主要株価は序盤から堅調な動きとなった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前日比520ドル高まで上昇した。その後は下げ幅を縮小したものの、401ドル高で終了となり、4営業日ぶりの大幅反発となった。一方、ハイテク株中心のナスダックも2.9%を超える大幅反発となった。



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	テクノロジー	2.49%	1	マイクロソフト	5.84%
2	金融	2.10%	2	ベライゾン	4.66%
3	資本財	1.96%	3	インテル	4.46%
4	ヘルスケア	1.83%	4	シスコシステムズ	3.18%
5	石油・ガス	1.10%	5	ユナイテッドH	3.09%

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。