

NY マーケットレポート (2018年11月27日)

2018年11月27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 | 21952.40 | +140.40 | -3.57% | USD/JPY | 113.79 | 113.84 | 113.41 |
| ハンセン指数 | 26331.96 | -44.22 | -11.99% | EUR/JPY | 128.52 | 128.85 | 128.36 |
| 上海総合 | 2574.68 | -1.13 | -22.15% | GBP/JPY | 144.86 | 145.60 | 144.61 |
| 韓国総合 | 2099.42 | +16.40 | -14.92% | AUD/JPY | 82.22 | 82.57 | 81.83 |
| 豪ASX200 | 5728.28 | +56.71 | -5.55% | NZD/JPY | 77.27 | 77.33 | 76.63 |
| インドSENSEX | 35513.14 | +159.06 | 4.28% | EUR/USD | 1.1295 | 1.1344 | 1.1278 |

| 欧州主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|--------------|----------|---------|---------|
| 英FT100 | 7016.85 | -19.15 | -8.73% |
| 仏CAC40 | 4983.15 | -11.83 | -6.20% |
| 独DAX | 11309.11 | -45.61 | -12.45% |
| スペインIBX35 | 9085.60 | -5.60 | -9.54% |
| イタリアFTSE MIB | 19150.38 | -83.07 | -12.37% |
| 南ア全株指数 | 51353.98 | -336.14 | -13.70% |

| 米国主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|---------|----------|----------|---------|
| 米ダウ平均 | 24748.73 | +108.49 | 0.12% |
| S&P500 | 2682.17 | +8.72 | 0.32% |
| NASDAQ | 7082.70 | +0.85 | 2.60% |
| 南北米主要株価 | 終値 | 前日比 | 年初来% |
| トロント総合 | 14944.09 | -68.56 | -7.80% |
| ボルサ指数 | 39807.28 | +380.01 | -19.34% |
| ボベスパ指数 | 87891.18 | +2344.67 | 15.04% |

※一部暫定値

| コモディティ | 終値 | 前日比 | 年初来% |
|---------|---------|--------|--------|
| NY GOLD | 1213.40 | -9.00 | -6.7% |
| NY 原油 | 51.56 | -0.07 | -13.8% |
| CBOTコーン | 368.50 | +0.50 | 1.6% |
| CRB指数 | 179.92 | -0.377 | -7.2% |
| ドル指数先物 | 97.382 | +0.308 | 5.7% |
| VIX指数 | 19.02 | +0.12 | 72.3% |

| Crypto Currency | 本日 | 前日 |
|---------------------|--------|--------|
| CBOE Bitcoin(先物・期近) | 3750 | 3620 |
| CME Bitcoin(先物・期近) | 3760 | 3625 |
| Ripple (BSTP) | 0.358 | 0.346 |
| Ethereum (BSTP) | 108.64 | 104.27 |
| Bitcoin Cash | 177.95 | 176.28 |

| 日本国債利回り | 本日 | 前日 |
|-----------|---------|---------|
| 2年債 | -0.140% | -0.140% |
| 5年債 | -0.100% | -0.105% |
| 10年債 | 0.092% | 0.090% |
| 30年債 | 0.813% | 0.816% |
| 欧州国債利回り | | |
| ドイツ10年債 | 0.350% | 0.361% |
| 英国 10年債 | 1.392% | 1.410% |
| フランス 10年債 | 0.730% | 0.740% |
| 米国債利回り | | |
| 2年債 | 2.833% | 2.830% |
| 3年債 | 2.861% | 2.855% |
| 5年債 | 2.890% | 2.885% |
| 7年債 | 2.972% | 2.967% |
| 10年債 | 3.057% | 3.054% |
| 30年債 | 3.319% | 3.311% |

11/28 経済指標スケジュール

| | |
|-------|-----------------------|
| 09:01 | 【英国】11月BRC店頭価格指数 |
| 16:00 | 【南アフリカ】3Q BER消費者信頼感 |
| 17:00 | 【スウェーデン】11月消費者信頼感指数 |
| 17:00 | 【スウェーデン】11月景気動向調査 |
| 17:00 | 【スウェーデン】11月小売売上高 |
| 18:00 | 【スイス】11月クレディスイス景気期待指数 |
| 18:00 | 【欧州】10月マネーサプライM3 |
| 21:00 | 【米国】MBA住宅ローン申請指数 |
| 21:00 | 【ドイツ】12月GfK消費者信頼感調査 |
| 22:30 | 【米国】3Q GDP |
| 22:30 | 【米国】3Q 個人消費 |
| 22:30 | 【米国】3Q GDP価格指数 |
| 22:30 | 【米国】10月卸売在庫 |
| 00:00 | 【米国】10月新築住宅販売件数 |
| 00:00 | 【米国】11月リッチモンド連銀製造業指数 |
| 00:30 | 【米国】EIA原油在庫 |

11/28 主要会議・講演・その他予定

- ・パウエルFRB議長 講演
- ・米7年債入札
- ・欧州議会本会議 (~29日)

NY 市場レポート

<< NY 市場概況 >>

NY 市場では、米主要株価が軟調な展開で始まり、ダウ平均株価が一時 220 ドルを上回る下落となったことから、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。しかし、米消費者信頼感指数が予想通りの低下に留まったことが好感されたことや、クドロー米国家経済会議（NEC）委員長が、米中首脳会談での合意の可能性に言及したことを受けて、米中首脳会談に対する期待感が高まった。また米主要株価がプラス圏まで反発したことも加わり、ドル円・クロス円は底固い動きとなった。

主要な米経済指標結果

9 月住宅価格指数（前月比） 0.2%（予想 0.4%・前回 0.3%⇒0.4%）

3Q 住宅価格指数（前期比） 1.3%（前回 1.1%⇒1.3%）



出所：Bloomberg

9 月 S&P/ケース・シラー[総合 20]（前年比） 5.15%（予想 5.20%・前回 5.49%⇒5.53%）

9 月の S&P/ケース・シラーの 20 都市住宅価格指数は、前年比+5.15%となり、約 2 年ぶりの低い伸びとなった。住宅価格指数の伸び鈍化はこれで 6 ヶ月連続。住宅ローン金利の上昇や高い不動産価格が影響し、買い控えが広がりつつある。



出所：Bloomberg

11月消費者信頼感指数 135.7 (予想 135.7・前回 137.9)

11月の米消費者信頼感指数は、135.7（1985年=100）となり、前月の137.9から2.2ポイント低下した。景気の現状に対する信頼感指数は172.7（前月171.9）と前月から上昇する一方、向こう半年の期待指数は111.0（115.1）と低下した。雇用関連では、現状は「職が豊富」との回答は46.6%（前月45.4%）、「就職が困難」は12.2%（前月13.4%）、向こう半年では「求職が増える」との回答は22.8%（前月22.3%）、「求職が減る」は11.1%（前月10.6%）。向こう1年間のインフレ見通しは4.9%、前月から0.1ポイント上昇。



出所：Bloomberg

要人発言

クラリダ FRB 副議長

- ・ 漸進的な利上げを支持、中立金利は不透明
- ・ リスクは3年前ほどダウンサイドに傾斜していない
- ・ インフレが目標上回れば政策見直し調整へ
- ・ 金融市場は消費者物価指数の上昇率が2%程度で推移すると見ている
- ・ PCE は歴史的に CPI よりも 0.3 ポイント程度低い
- ・ 米国経済の基礎は力強い
- ・ もし私の予測通りならば、来年も景気拡大が続き、拡大期は史上最長になるだろう

クドロー米国家経済会議 (NEC) 委員長

- ・ 米中首脳、12/1 に夕食の席で会談へ
- ・ トランプ米大統領は会談の成果に期待、追加関税の用意も

ブラード・セントルイス連銀総裁

- ・ 米経済にひびが入っているのかがどうか、金融当局にこの先待ち受ける主な課題の一つだ
- ・ 経済が2019年と20年に減速することに疑いの余地は全くない
- ・ 経済がこれまでより減速する中で、現在のようなペースで利上げを継続するのはずっと困難
- ・ 潜在成長率が1.8%ならば、経済はその水準付近に戻っていくだろう

エバンス・シカゴ連銀総裁

- ・ 政策スタンスを中立にする時期
- ・ 米経済データは経済の強さを示している

米主要株価は続伸

米株式市場は、トランプ米大統領が対中追加関税の可能性に言及したことから、米中貿易摩擦の激化が懸念され、主要株価が序盤から軟調な動きとなった。その後、クドロー米国家経済会議（NEC）委員長が、米中首脳会談での合意の可能性に言及したことから、米中首脳会談に対する期待感が高まり、主要株価はプラス圏に反発した。ダウ平均株価は、序盤から軟調な動きとなり、一時前日比 224 ドル安まで下落したが、その後は終盤まで堅調な動きが続き、108 ドル高で終了した。一方、ハイテク株中心のナスダックもプラス圏まで反発したが、小幅高に留まった。



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 | 通信サービス | 2.50% | 1 | ベライゾン | 2.50% |
| 2 | ヘルスケア | 1.61% | 2 | ウォルグリーンBA | 2.23% |
| 3 | 消費者サービス | 1.12% | 3 | ホームデポ | 2.00% |
| 4 | テクノロジー | 0.39% | 4 | ユナイテッドH | 1.87% |
| | 素材 | -0.83% | | ユナイテッドT | -4.14% |

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。