

NYマーケットレポート (2023年10月19日)

2023年10月19日(木)

アジア主要株価指数	終値	前日比	年初来%
日経平均	31,430.62	-611.63	20.45%
ハンセン指数	17,295.89	-436.63	-12.56%
上海総合	3,005.39	-53.32	-2.71%
韓国総合	2,415.80	-46.80	8.02%
豪ASX200	6,981.60	-96.00	-0.81%
シンガポールST	3,099.60	-37.02	-4.67%
インドSENSEX	65,629.25	-247.77	7.87%

外国為替	終値	高値	安値
USD/JPY	149.83	149.96	149.67
EUR/JPY	158.57	158.93	157.68
GBP/JPY	181.93	182.52	181.18
AUD/JPY	94.83	95.17	94.32
EUR/USD	1.0583	1.0615	1.0528
BRL/JPY	29.541	29.712	29.350
RUB/JPY	1.504	1.505	1.481

欧州主要株価指数	終値	前日比	年初来%
英FT100	7,499.53	-88.47	0.64%
仏CAC40	6,921.37	-44.62	6.91%
独DAX	15,045.23	-49.68	8.06%
スペインIBX35	9,146.80	-65.90	11.15%
イタリアFTSE MIB	27,746.82	-388.97	17.04%
トルコ・イスタンブール100	7,769.03	-73.63	41.02%
ロシアRTS	1,056.54	+5.37	8.85%
南ア全株指数	70,961.33	-1007.34	-2.86%

Commodity	終値	前日比	年初来%
NY GOLD	1,980.50	+12.20	8.45%
NY 原油	89.37	+1.05	11.35%
CBOTコーン	505.00	+13.00	-25.57%
CRB指数	287.34	+1.510	3.45%
ドル指数先物	106.253	-0.312	2.67%
VIX指数	21.40	+2.18	-1.25%

米主要株価指数	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	33,414.17	-250.91	0.81%
S&P500	4,278.00	-36.60	11.42%
NASDAQ	13,186.18	-128.12	25.98%

南北米主要株価指数	終値	前日比	年初来%
カナダ・トロント総合	19,348.81	-101.89	-0.19%
メキシコ・ボルサ指数	48,804.61	-470.17	0.70%
ブラジル・ボベスパ指数	114,004.30	-55.34	3.89%

Crypto Currency	本日	前日
CME Bitcoin(先物・期近)	28865	28345
XRP(Ripple) [BSTP]	0.501	0.489
Ethereum [BSTP]	1565.98	1562.72
Bitcoin Cash	230.06	227.18

オセアニア国債利回り	本日	前日
オーストラリア10年債	4.781%	4.647%
ニュージーランド10年債	5.555%	5.448%

日本国債利回り	本日	前日
2年債	0.081%	0.070%
10年債	0.840%	0.809%
30年債	1.798%	1.768%

10/20 経済指標スケジュール
08:01 【英国】10月GfK消費者信頼感調査
08:30 【日本】9月全国消費者物価指数
14:00 【日本】9月コンビニエンスストア売上高
15:00 【ドイツ】9月生産者物価指数
15:00 【欧州】9月新車Eu台数[EU-27]
15:00 【英国】9月公共部門純借入所要額
15:00 【英国】9月公的部門純借入額
15:00 【英国】9月小売売上高指数
17:30 【香港】9月消費者物価指数
21:30 【カナダ】8月小売売上高

欧州国債利回り	本日	前日
ドイツ10年債	2.927%	2.921%
英国 10年債	4.670%	4.654%
フランス 10年債	3.546%	3.552%
イタリア 10年債	4.939%	4.977%
スペイン 10年債	4.031%	4.051%

米国債利回り	本日	前日
2年債	5.159%	5.223%
10年債	4.990%	4.915%
30年債	5.110%	4.995%

10/20 主要会議・講演・その他予定
・植田日銀総裁 講演
・フィラデルフィア連銀総裁 講演
・クリーブランド連銀総裁 講演
米第3四半期決算～アメリカンエキスプレス、その他

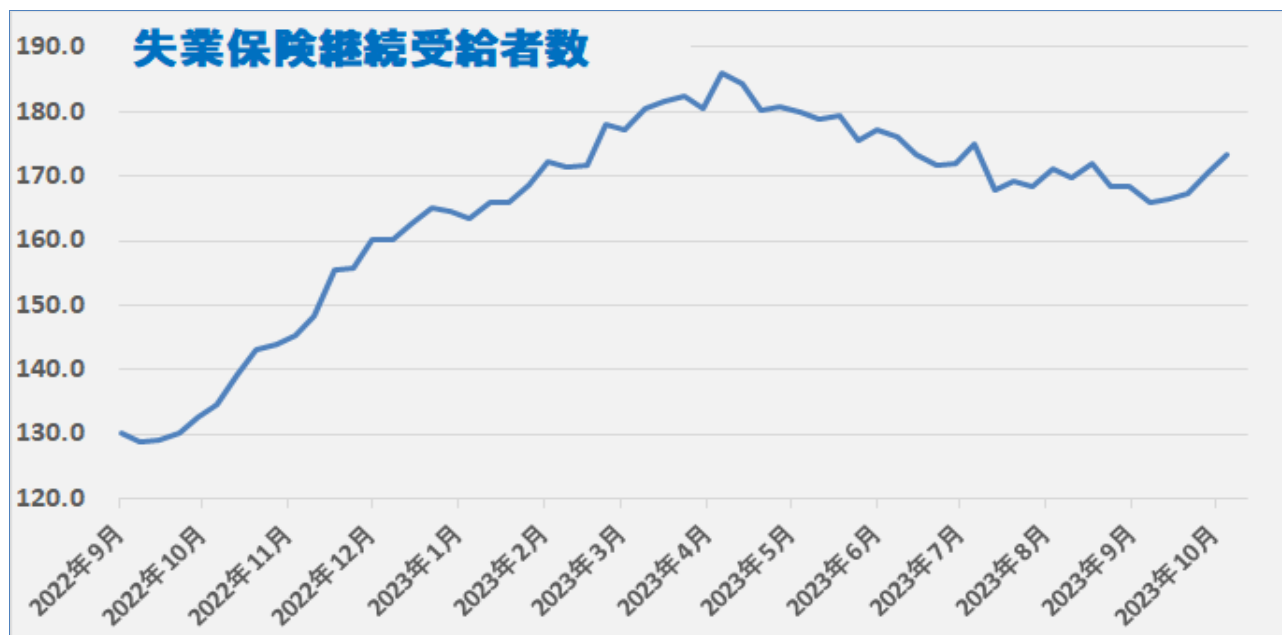
NY 市場レポート（前日 21 時 00 分～午前 5 時 30 分まで）

米国の主要な経済指標の結果

新規失業保険申請件数 19.8 万件（予想 21.2 万件・前回 20.9 万件⇒21.1 万件）

失業保険継続受給者数 173.4 万人（予想 170.0 万人・前回 170.2 万人⇒170.5 万人）

米新規失業保険申請件数（10/14 までの週）は、市場予想を下回る前週比-1.3 万件となり、1 月以来の低水準となった。労働市場が引き続き堅調に推移していることが示唆されたが、コロンブスデーを含む週だったことが影響している可能性も指摘された。。一方、発表が 1 週遅れる失業保険継続受給者数（10/7 までの週）は、市場予想を上回り 7 月以来の高水準となった。



データを基に SBILM が作成

9月中古住宅販売件数 396 万件（予想 388 万件・前回 404 万件）

9月中古住宅販売件数（前月比）-2.0%（予想 -4.0%・前回 -0.7%）

9月の米中古住宅販売件数は、市場予想を上回ったものの、4ヵ月連続の減少で2010年10月以来、12年11ヵ月ぶりの低水準となった。中古住宅の在庫不足と価格高騰、住宅ローン金利の高止まりが引き続き影響していることが示された。一戸建ては-1.9%の353万件、集合住宅は-2.3%の43万件。地域別では、北東部が+4.2%となったものの、西部は-5.3%、中西部は-4.1%、南部は-1.1%となった。



データを基に SBILM が作成

パウエル FRB 議長の主な発言

- ・ 力強い経済の追加証拠があれば利上げに値する可能性
- ・ リスクや累積利上げ踏まえ FOMC は慎重に進めている
- ・ 地政学的緊張は非常に高まっており主なリスクに
- ・ 金融環境の動向が根強い場合政策に影響も
- ・ 金利の高さ期間が十分ではない可能性も
- ・ 現在の金利水準が引き締め過ぎとの証拠はない
- ・ 長期の潜在成長率は 2%程度だと推測される
- ・ 現在の政策は引き締め過ぎでないことは明らかだ
- ・ 今現在のリスクは依然高いインフレだ
- ・ 利回り上昇は利上げの必要性低下を意味し得る

ダウ平均は続落、ナスダックは3営業日続落

米株式市場では、パウエルFRB議長が講演を控えて序盤から小動きの展開となった。パウエルFRB議長は講演で追加利上げの可能性に言及し、米長期金利が上昇したことを受けて、主要株価指数は軒並み下落した。しかし、政策に対する慎重姿勢を示したことから上昇に転じる場面もあった。その後は、米長期金利が高止まりしていることもあり、引けにかけて主要株価指数は軟調な動きが続いた。ダウ平均株価は、FRB議長の発言後に一時前日比187ドル高まで上昇したものの、その後は下落に転じて終盤に296ドル安まで下落した。引けにかけて下げ幅を縮小したものの、250.91ドル安(-0.75%)で終了。一方、ハイテク株中心のナスダックは128.12ポイント安(-0.96%)で終了した。



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	1.57%	1	トラベラーズ	-2.48%
2	素材	1.26%	2	キャタピラー	-2.44%
3	金融	-1.23%	3	ウォルトディズニー	-1.69%
4	ヘルスケア	-0.87%	4	ボーイング	-1.56%
5	消費財	-0.79%	5	ビザ	-1.54%

データを基にSBILMが作成

ドル円・クロス円は上値の重い動き

NY 市場では、序盤に発表された米経済指標が強弱まちまちの結果となったことから、序盤の値動きは限定的だった。その後、パウエル FRB 議長の講演で追加利上げの可能性に言及したことを受けて、米金利上昇とともにドルは主要通貨に対して堅調な動きとなり、ドル/円は一時 149.96 まで上昇して 10/3 以来の高値を更新した。しかし、慎重な姿勢を示したことや、地政学的リスクに言及するとドルは一転して下落となり、ドル/円は 149.69 まで下落するなど、その後も発言を受けてレンジ内で乱高下する動きとなった。



出所：総合分析チャート

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自身でお願いします。