

NY マーケットレポート (2023年10月26日)

2023年10月26日 (木)

アジア主要株価指数	終値	前日比	年初来%
日経平均	30,601.78	-668.14	17.27%
ハンセン指数	17,044.61	-40.72	-13.84%
上海総合	2,988.30	+14.19	-3.27%
韓国総合	2,299.08	-64.09	2.80%
豪ASX200	6,812.32	-42.02	-3.22%
シンガポールST	3,071.31	-7.47	-5.54%
インドSENSEX	63,148.15	-900.91	3.79%

外国為替	終値	高値	安値
USD/JPY	150.40	150.78	149.90
EUR/JPY	158.84	158.90	158.06
GBP/JPY	182.42	182.59	181.22
AUD/JPY	95.13	95.80	95.24
EUR/USD	1.0562	1.0569	1.0523
BRL/JPY	30.027	30.036	29.832
RUB/JPY	1.564	1.566	1.556

欧州主要株価指数	終値	前日比	年初来%
英FT100	7,354.57	-59.77	-1.30%
仏CAC40	6,888.96	-26.11	6.41%
独DAX	14,731.05	-161.13	5.80%
スペインIBX35	8,962.80	-22.00	8.92%
イタリアFTSE MIB	27,507.90	+79.30	16.03%
トルコ・イスタンブール100	7,662.05	+237.08	39.08%
ロシアRTS	1,084.78	-18.82	11.76%
南ア全株指数	69,930.50	-343.84	-4.27%

Commodity	終値	前日比	年初来%
NY GOLD	1,997.40	+2.50	9.37%
NY 原油	83.21	-2.18	3.68%
CBOTコーン	479.25	-0.75	-29.37%
CRB指数	281.52	-1.587	1.36%
ドル指数先物	106.602	+0.074	3.01%
VIX指数	20.68	+0.49	-4.57%

米主要株価指数	終値	前日比	年初来%
米ダウ平均	32,784.30	-251.63	-1.09%
S&P500	4,137.23	-49.54	7.75%
NASDAQ	12,595.61	-225.61	20.34%

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	18,875.31	-72.54	-2.63%
メキシコ・ボルサ指数	49,173.43	+407.10	1.46%
ブラジル・ボベスパ指数	114,776.86	+1946.89	4.59%

Crypto Currency	本日	前日
CME Bitcoin(先物・現貨)	34170	34760
XRP(Ripple)【BSTP】	0.552	0.554
Ethereum【BSTP】	1799.99	1787.95
Bitcoin Cash	246.87	252.51

オセアニア国債利回り	本日	前日
オーストラリア10年債	4.871%	4.716%
ニュージーランド10年債	5.477%	5.391%

日本国債利回り	本日	前日
2年債	0.087%	0.079%
10年債	0.875%	0.859%
30年債	1.852%	1.849%

10/27 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]
 09:30 【オーストラリア】3Q生産者物価指数
 10:30 【中国】9月工業利益
 15:45 【フランス】10月消費者信頼感指数
 21:30 【米国】9月個人所得
 21:30 【米国】9月個人支出
 21:30 【米国】9月PCEデフレーター
 23:00 【米国】10月ミシガン大学消費者信頼感指数

欧州国債利回り	本日	前日
ドイツ10年債	2.858%	2.886%
英国 10年債	4.595%	4.605%
フランス 10年債	3.486%	3.514%
イタリア 10年債	4.864%	4.908%
スペイン 10年債	3.963%	3.995%

米国債利回り	本日	前日
2年債	5.039%	5.121%
10年債	4.845%	4.955%
30年債	4.986%	5.086%

10/27 主要会議・講演・その他予定

- ・バーFRB副議長 講演
- ・欧州冬時間移行 (29日~)

米第3四半期決算~シェブロン、エクソンモービル、その他

NY 市場レポート（前日 21 時 00 分～午前 5 時 30 分まで）

主要な欧州経済指標の結果

欧州中銀 政策金利 4.50%（予想 4.50%・前回 4.50%）

欧州中銀 上限政策金利[限界貸出金利] 4.75%（予想 4.75%・前回 4.75%）

欧州中銀 下限政策金利[中銀預金金利] 4.00%（予想 4.00%・前回 4.00%）



ECB 声明

- ・ 基調的なインフレの指標は大半が緩和を続けている
- ・ 入ってくる情報はほぼこれまでに予測した通り
- ・ インフレ率は依然として高すぎる状態が長く続くと予想
- ・ 過去の利上げは引き続き金融政策に力強く反映されている
- ・ 金利水準は十分に長期間維持されなければならない

ラガルド ECB 総裁

- ・ インフレは依然として高いまま
- ・ ユーロ圏の経済は弱いままであり年内も同じような状態が続くだろう
- ・ 労働市場が弱まるサインが出ている
- ・ ユーロ圏内の価格圧力は依然強い
- ・ 成長に対するリスクは依然として下振れ方向
- ・ 利下げについて議論せず時期尚早だろう

米国の主要な経済指標の結果

3Q GDP（前期比年率） 4.9%（予想 4.3%・前回 2.1%）

3Q 個人消費（前期比） 4.0%（予想 4.0%・前回 0.8%）

7-9 月期の米 GDP 速報値は、市場予想を上回り、2021 年 10-12 月期以来、約 2 年ぶりの高水準となった。プラス成長は 5 四半期連続となり、米経済の堅調さが示された。個人消費は前期から大幅に伸び、住宅投資は +3.9% でプラスに転じ、設備投資は -0.1% とマイナスに転じた。一方、輸出は +6.2%、輸入は +5.7% となり、政府支出は +4.6% だった。



データを基に SBILM が作成

9月耐久財受注（前月比）4.7%（予想 1.5%・前回 0.1%⇒-0.1%）

9月耐久財受注[除輸送用機器] 0.5%（予想 0.3%・前回 0.4%⇒0.5%）

9月の耐久財受注は、市場予想を大幅に上回る伸びとなり、2020年7月以来の高い伸びとなった。ただ、変動の大きい輸送機器が12.7%（前月-1.1%）と大きく伸び、特に民間航空機が92.5%（前月-17.5%）となったことが指数を押し上げた。輸送用機器を除く受注は、前月と同じ伸びとなった。



データを基に SBILM が作成

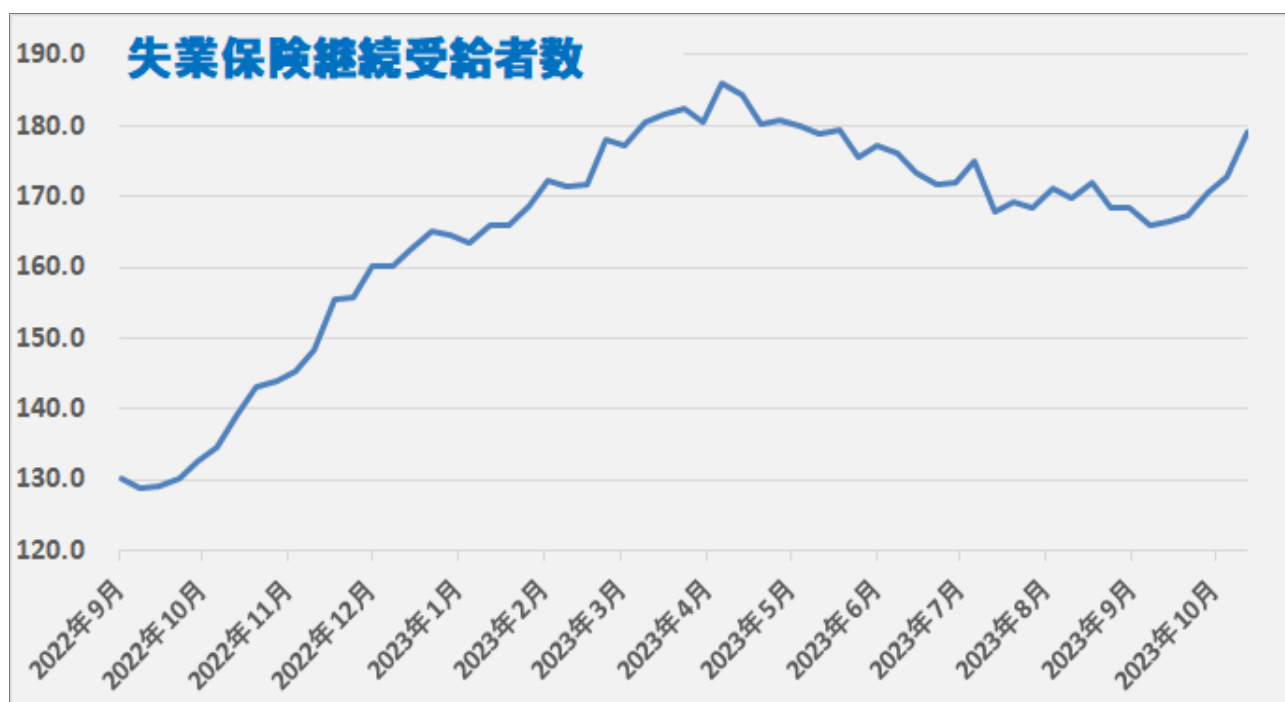
新規失業保険申請件数 21.0 万件（予想 20.8 万件・前回 19.8 万件⇒20.0 万件）

失業保険継続受給者数 179.0 万人（予想 173.8 万人・前回 173.4 万人⇒172.7 万人）

米新規失業保険申請件数（10/21 までの週）は、市場予想を上回り前週比+1 万件となったが、依然として低水準が続いている。一方、失業保険継続受給者数（10/14 までの週）は、+6.3 万人となり 5/19 までの週以来の高水準となり、4 週連続の増加となった。



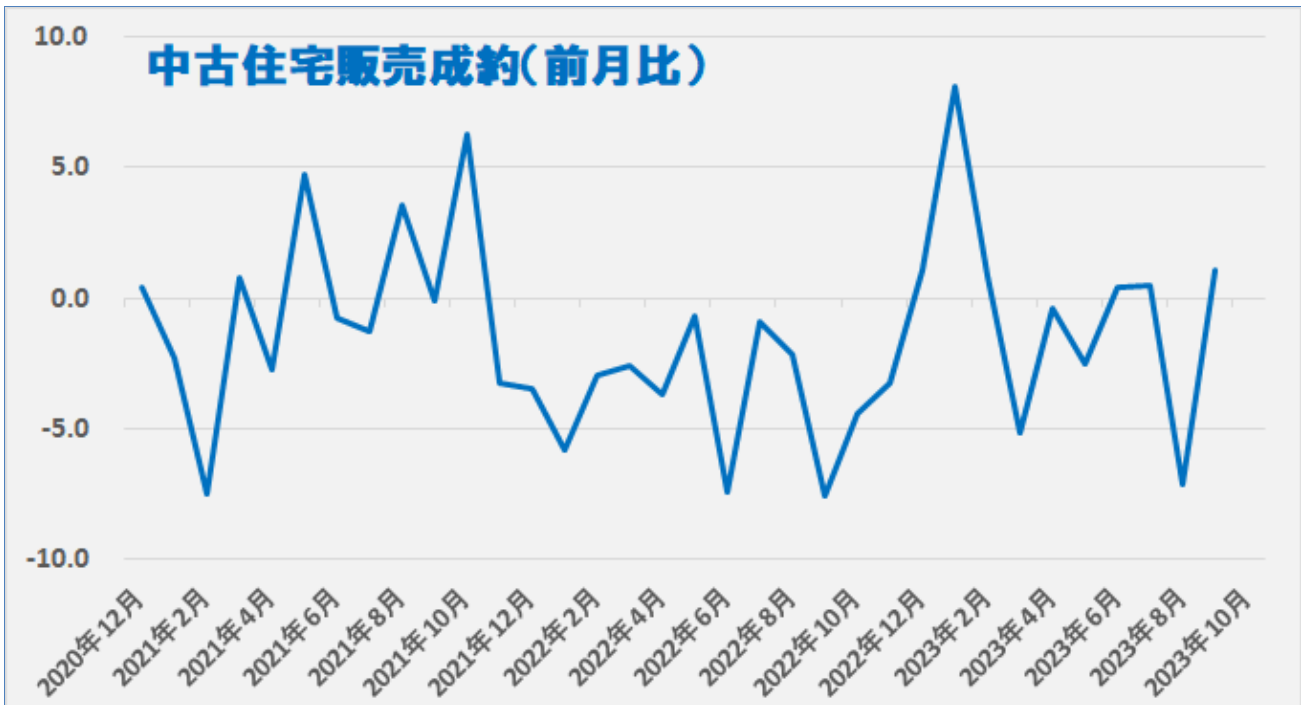
データを基に SBILM が作成



9月中古住宅販売成約（前月比）1.1%（予想 -1.6%・前回 -7.1%）

9月中古住宅販売成約（前年比）-13.1%（予想 -14.6%・前回 -18.8%）

9月の米中古住宅仮契約は、前月比で2ヵ月ぶりに上昇、前年比では22ヵ月連続のマイナスとなった。地域別では、西部が-1.8%と低下したが、中西部は+4.1%、北東部は+0.8%、南部は+0.7%となった。



データを基に SBILM が作成

主要株価指数は続落

米株式市場では、米経済指標が良好な結果となったことで、FRBの金融引き締め長期化観測から主要株価指数は序盤から軟調な動きとなった。その後、米長期金利が大幅に低下したことで、下げ幅を縮小する場面もあったが、米企業の四半期決算が冴えない結果となったことも影響し、引けにかけて再び下げ幅を拡大した。ダウ平均株価は、序盤に前日比69ドル高まで上昇したものの、その後は下落に転じて291ドル安まで下落した。下げ一服後は15ドル高まで値を戻したものの、終盤にかけて再び下落に転じて251.63ドル安(-0.76%)で終了した。一方、ハイテク株中心のナスダックは、225.61ポイント安(-1.76%)で終了した。



データを基にSBILMが作成

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	-1.30%	1	マイクロソフト	-3.75%
2	消費者サービス	-1.20%	2	ナイキ	-3.40%
3	資本財	-0.90%	3	アップル	-2.46%
4	エネルギー	-0.72%	4	ピザ	-2.35%
5	消費財	-0.49%	5	シスコシステムズ	-1.97%

データを基にSBILMが作成

ドルは主要通貨に対して上値の重い動き

NY 市場では、序盤に発表された米 GDP 速報値や耐久財受注が市場予想を上回ったことを受けて、ドルは主要通貨に対して上昇した。しかし、米長期金利が低下に転じると、ドルも一転して下落となり、ドル/円は指標発表後の高値 150.52 から 150.09 まで下落した。その後に発表された米中古住宅販売仮契約が 1 月以来の高い伸びとなったことから、ドルは再び堅調な動きとなり、ドル/円は 150.50 まで値を戻した。ただ、米長期金利の低下が続いたことから、終盤まで上値の重い動きが続いた。一方、ラガルド ECB 総裁が会見でユーロ圏経済の弱さに言及したことを受けてユーロは主要通貨に対して下落したが、下げ一服後はドルや円に対して堅調な動きとなった。



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ご自身でお願いします。