

NYマーケットレポート (2023年11月1日)

2023年11月1日 (水)

アジア主要株価指数	終値	前日比	年初来%	外国為替	終値	高値	安値
日経平均	31,601.65	+742.80	21.10%	USD/JPY	150.95	151.68	150.67
ハンセン指数	17,101.78	-10.70	-13.55%	EUR/JPY	159.57	160.44	159.07
上海総合	3,023.08	+4.31	-2.14%	GBP/JPY	183.35	184.30	182.95
韓国総合	2,301.56	+23.57	2.91%	AUD/JPY	96.42	96.50	95.62
豪ASX200	6,838.31	+57.63	-2.85%	EUR/USD	1.0570	1.0581	1.0518
シンガポールST	3,076.77	+9.03	-5.37%	BRL/JPY	30.249	30.259	29.830
インドSENSEX	63,591.33	-283.60	4.52%	RUB/JPY	1.583	1.589	1.575

欧州主要株価指数	終値	前日比	年初来%	Commodity	終値	前日比	年初来%
英FT100	7,342.43	+20.71	-1.47%	NY GOLD	1,987.50	-6.80	8.83%
仏CAC40	6,932.63	+46.98	7.09%	NY 原油	80.44	-0.58	0.22%
独DAX	14,923.27	+112.93	7.18%	CBOTコーン	475.00	-3.75	-29.99%
スペインIBX35	9,075.00	+57.70	10.28%	CRB指数	279.08	-2.071	0.48%
イタリアFTSE MIB	27,985.44	+243.53	18.05%	ドル指数先物	106.884	+0.221	3.28%
トルコ・イスタンブール100	7,528.57	+14.47	36.66%	VIX指数	16.87	-1.27	-22.15%
ロシアRTS	1,088.42	+8.54	12.14%				
南ア全株指数	69,740.30	+86.86	-4.53%				

米主要株価指数	終値	前日比	年初来%	Crypto Currency	本日	前日
米ダウ平均	33,274.58	+221.71	0.38%	CME Bitcoin(先物・現貨)	35900	35045
S&P500	4,237.86	+44.06	10.38%	XRP(Ripple)【BSTP】	0.615	0.601
NASDAQ	13,061.47	+210.23	24.79%	Ethereum【BSTP】	1849.65	1814.95
南北米主要株価指数	終値	前日比	年初来%	Bitcoin Cash	245.85	243.54
カナダ・トロント総合	19,079.00	+205.53	-1.58%			
メキシコ・ボルサ指数	49,787.84	+725.96	2.73%			
ブラジル・ボベスパ指数	115,052.96	+1909.29	4.85%			

11/2 経済指標スケジュール

- 08:50 【日本】10月マネタリーベース
- 09:30 【オーストラリア】9月持家住宅ローン件数
- 09:30 【オーストラリア】9月貿易収支
- 16:30 【スイス】10月消費者物価指数
- 16:45 【フランス】9月財政収支【年初来】
- 17:00 【スイス】4Q SECO消費者信頼感指数
- 17:50 【フランス】10月製造業PMI
- 17:55 【ドイツ】10月失業率
- 17:55 【ドイツ】10月失業者数
- 17:55 【ドイツ】10月製造業PMI
- 18:00 【欧州】10月製造業PMI
- 18:00 【ノルウェー】政策金利
- 20:30 【米国】10月チャレンジャー人員削減数
- 21:00 【英国】政策金利
- 21:00 【英国】英中銀 四半期インフレ報告
- 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
- 21:30 【米国】3Q非農業部門労働生産性
- 23:00 【米国】9月製造業受注指数
- 23:00 【米国】9月耐久財受注

オセアニア国債利回り	本日	前日
オーストラリア10年債	4.943%	4.922%
ニュージーランド10年債	5.486%	5.533%
日本国債利回り		
2年債	0.164%	0.129%
10年債	0.961%	0.947%
30年債	1.900%	1.872%

欧州国債利回り	本日	前日
ドイツ10年債	2.760%	2.803%
英国 10年債	4.493%	4.507%
フランス 10年債	3.378%	3.424%
イタリア 10年債	4.717%	4.720%
スペイン 10年債	3.831%	3.877%
米国債利回り		
2年債	4.944%	5.087%
10年債	4.734%	4.931%
30年債	4.927%	5.093%

11/2 主要会議・講演・その他予定

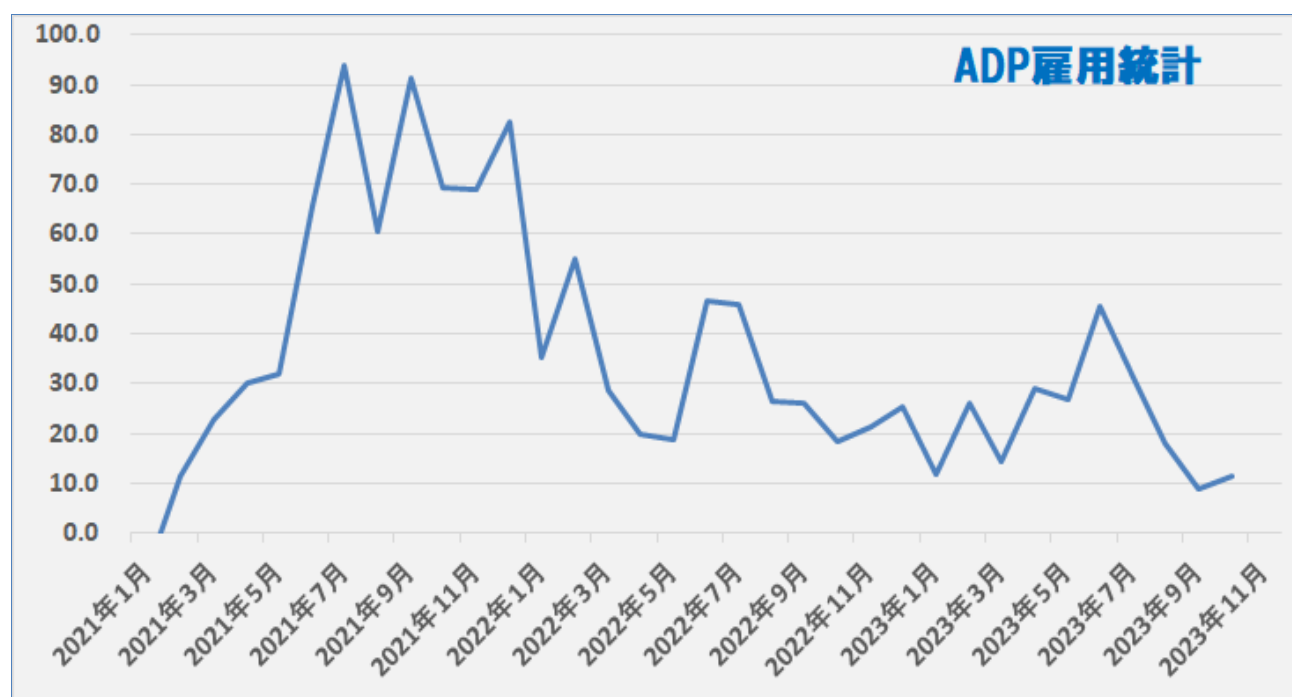
- ・ベリリー-BOE総裁 会見
- 米第3四半期決算～モデルナ、フォックス、アップル、スターバックス、コインベース、エクスペディア、その他

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

10 月 ADP 雇用統計 11.3 万人（予想 15.0 万人・前回 8.9 万人）

10 月の米 ADP 雇用統計では、雇用者数の伸びが市場予想を下回り、労働者の需要が低下していることが示された。ただ、前月の結果からは伸び幅が拡大した。教育・医療サービスや貿易・運輸がけん引し、娯楽・ホスピタリティーは 2022 年 1 月以来の小幅な伸びとなった。また、専門職・ビジネスサービスは人員を削減した。



データを基に SBILM が作成

10月ISM製造業景況指数 46.7 (予想 49.0・前回 49.0)

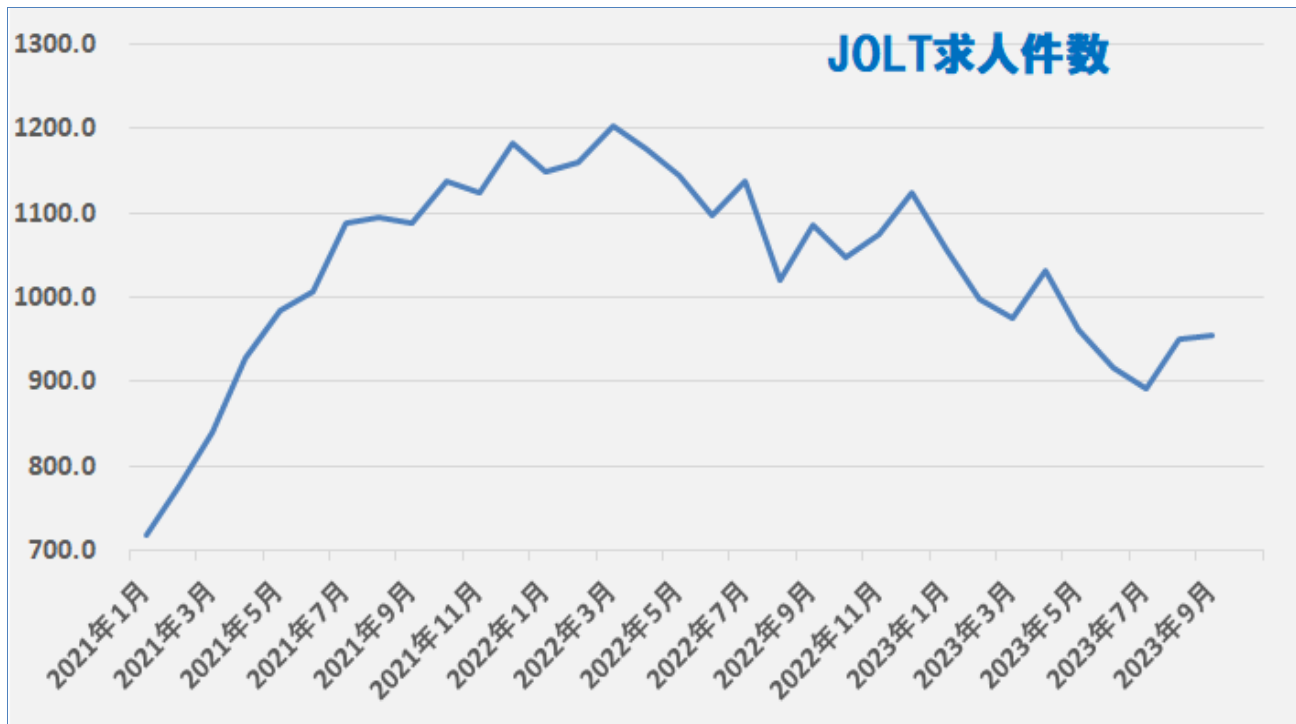
10月の米ISM製造業景況指数は、市場予想を下回り、前月から2.3ポイント低下した。また、製造業の景気拡大・縮小の判断基準となる50を12ヵ月連続で下回った。新規受注が15.5(前月49.2)、生産が50.4(52.5)、雇用が46.8(51.2)、在庫が43.3(45.8)といずれも低下したものの、仕入れ価格は45.1(43.8)と上昇した。10月は2業種が景況拡大を、13業種が業況の縮小を報告した。



データを基に SBILM が作成

9月 JOLT 求人数 955.3 万件（予想 926.5 万件・前回 961.0 万件⇒949.7 万件）

9月の米求人数は、市場予想を上回り、2ヵ月連続でプラスとなった。経済のさまざまなセクターで労働市場が力強さを維持していることが浮き彫りになった。一方、離職率は3ヵ月連続で2.3%と2021年1月以来の最低を維持し、労働者が別の仕事を見つけにくくなっている状況が示された。



データを基に SBILM が作成

FOMC 政策金利 5.25%-5.50% (予想 5.25%-5.50%・前回 5.25%-5.50%)



データを基に SBILM が作成

主な FOMC の声明

- ・ 最近の指標は経済活動が第 3 四半期に堅調なペースで拡大したことを示している。
- ・ インフレ率は引き続き高止まりしている。
- ・ 家計や企業の金融・信用状況の引き締まりが経済活動、雇用、インフレの重しになる可能性がある。
- ・ 雇用最大化と長期的な 2%のインフレ率の達成を目指す。
- ・ 目標を支援するため FF 金利の目標誘導レンジを 5.25–5.50%で据え置くことを決定した。
- ・ インフレ率を 2%の目標に戻すことに強く取り組む。
- ・ 標の達成を妨げる可能性があるリスクが生じた場合、目標の達成を妨げる可能性がある
- ・ リスクが生じた場合、金融政策の姿勢を適切に調整する準備がある。
- ・ 今回の金融政策決定は全会一致

パウエル FRB 議長の主な発言

- ・ 経済活動は急速に拡大。
- ・ 政策スタンスは制限的、引き締め完全な影響はまだ感じられない。
- ・ FRB はインフレ率を 2%の目標に引き下げることに強くコミット。
- ・ これまでの進展を考慮して FOMC は慎重に進んでいる。
- ・ 2%の目標への道のりは長い。
- ・ 潜在的な GDP を上回る証拠があれば利上げが正当化される可能性。
- ・ 我々は長期金利の上昇に注意を払っている。
- ・ 現時点では利下げについては全く考えていない。
- ・ 委員会は利下げについて検討、協議していない。
- ・ FOMC が問うのは追加利上げの是非。
- ・ 物価の安定を回復するには、依然として成長の鈍化と労働市場の軟化が必要になる可能性が高い

ダウ平均は3営業日続伸、ナスダックは4営業日続伸

米株式市場では、FOMCの結果発表を控え、金融引き締め長期化観測が和らぐとの見方から主要株価指数は序盤から堅調な動きとなった。その後は様子見となったものの、FOMCで政策金利が据え置かれたことや、会見でFRB議長の発言がタカ派ではないと受け止められたことから、主要株価指数は再び堅調な動きとなった。また、米長期金利が低下したことも好感され、金利動向に敏感なナスダックは上げ幅を拡大した。ダウ平均株価は、序盤に228ドル高まで上昇したものの、その後は5ドル高まで上げ幅を縮小した。ただ、FOMC後に上げ幅を拡大し、一時前日比284ドル高まで上昇する場面もあり、221.71ドル高（0.67%）で終了。一方、ナスダックは210.23ポイント高（+1.64%）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	テクノロジー	1.77%	1	キャタピラー	2.56%
2	資本財	1.18%	2	マイクロソフト	2.35%
3	金融	0.86%	3	インテル	2.16%
4	通信サービス	0.38%	4	アマゾン	2.01%
5	ヘルスケア	0.16%	5	アップル	1.87%

データを基にSBILMが作成

ドルは主要通貨に対して下落

NY市場では、序盤に発表された10月の米ADP雇用統計が市場予想を下回ったことから、ドルは上値の重い動きとなった。その後、ドルは持ち直したものの、米財務省が長期債入札の増額規模の縮小を発表したことや、10月米ISM製造業景況指数が市場予想下回り3ヵ月ぶりの低水準となったことを受けて米金利が低下となり、ドルは一段の下落となった。ドル/円は、序盤の高値の151.38から150.82まで下落した。FOMCでは、米経済には耐性があると指摘し、追加利上げも否定しなかったことを受けて、ドル/円は151.24まで上昇する場面もあったが、米金利の低下が続いたことからドルは引けにかけて主要通貨に対して下落となり、対円でも150.67まで下落した。



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。