

NY マーケットレポート (2018 年 4 月 16 日)

2018年4月16日 (月)

アジア主要株価	終値	前日比	年初来%	TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
日経平均	21835.53	+56.79	-4.08%	USD/JPY	107.22	107.61	107.13
ハンセン指数	30315.59	-492.79	1.33%	EUR/JPY	132.47	132.65	132.12
上海総合	3110.65	-48.40	-5.94%	GBP/JPY	153.86	153.33	152.66
韓国総合	2457.49	+2.42	-0.41%	AUD/JPY	83.35	83.65	83.11
豪ASX200	5841.34	+12.26	-3.69%	NZD/JPY	78.90	79.12	78.71
インドSENSEX	34305.43	+112.78	0.73%	EUR/USD	1.2357	1.2359	1.2324

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	7198.20	-66.36	-6.37%	NY GOLD	1350.70	+2.80	3.4%
仏CAC40	5312.96	-2.06	0.01%	NY 原油	66.22	-1.17	10.0%
独DAX	12391.41	-50.99	-4.07%	COBTコーン	391.00	-3.50	9.1%
スペインIBX35	9766.10	-1.20	-2.77%	CRB指数	199.55	-0.150	2.9%
イタリアFTSE MIB	23329.31	-1.01	6.75%	ドル指数先物	89.425	-0.375	-2.9%
南ア全株指数	56733.47	+170.30	-4.66%	VIX指数	16.56	-0.85	48.5%

米国主要株価	終値	前日比	年初来%	NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
米ダウ平均	24573.04	+212.90	-0.59%	USD/JPY	107.10	107.39	107.04
S&P500	2677.84	+21.54	0.16%	EUR/JPY	132.60	132.97	132.50
NASDAQ	7156.28	+49.63	3.66%	GBP/JPY	153.56	153.76	153.29
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%	AUD/JPY	83.34	83.45	83.26
トロント総合	15300.38	+26.41	-5.61%	EUR/USD	1.2381	1.2395	1.2359
ボルサ指数	48434.39	-333.91	-1.86%				
ボベスパ指数	82861.58	-1472.84	8.45%				

※一部暫定値

4/17 経済指標スケジュール

09:30	【シンガポール】3月輸出
09:30	【シンガポール】3月電子機器輸出
10:30	【オーストラリア】4月豪中銀議事録
11:00	【中国】1Q GDP
11:00	【中国】3月小売売上高
11:00	【中国】3月鉱工業生産
11:00	【中国】3月固定資産投資
12:00	【ニュージーランド】3月非居住者国債保有率
13:30	【日本】2月鉱工業生産
13:30	【日本】2月稼働率指数
17:30	【英国】3月失業率
17:30	【英国】3月失業者数推移
17:30	【英国】2月ILO失業率
18:00	【欧州】【ドイツ】4月ZEW景況感調査
20:30	【トルコ】2月住宅価格指数
21:30	【米国】3月住宅着工件数
21:30	【米国】3月建設許可件数
21:30	【カナダ】2月国際証券取扱高
21:30	【カナダ】2月製造業出荷
22:15	【米国】3月鉱工業生産
22:15	【米国】3月設備稼働率

4/17 主要会議・講演・その他予定

- ・日米首脳会談 (～18日)
- ・サンフランシスコ連銀総裁 講演
- ・シカゴ連銀総裁 講演
- ・クオールズFRB副議長 議会証言

Crypto Currency	本日	前日
CBOE Bitcoin(先物・期近)	7980	7900
CME Bitcoin(先物・期近)	7990	7890
Ripple (BSTP)	0.657	0.683
Ethereum (BSTP)	502.68	524.66
Bitcoin Cash	758.55	777.27

*USD 6:00時点

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.146%	-0.150%
5年債	-0.101%	-0.106%
10年債	0.047%	0.038%
30年債	0.711%	0.698%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.525%	0.511%
英国 10年債	1.463%	1.435%
フランス 10年債	0.750%	0.740%
米国債利回り		
2年債	2.377%	2.357%
3年債	2.519%	2.500%
5年債	2.679%	2.673%
7年債	2.782%	2.777%
10年債	2.827%	2.827%
30年債	3.025%	3.027%

NY 市場レポート

◀ NY 市場概況 ▶

NY 市場では、ロシアと中国が自国通貨を押し下げているとのトランプ大統領のツイートが材料視され、ドル買い・円売りとなった。そして、貿易摩擦への懸念が再燃したことから円が買われ、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。その後、米国債利回りの低下も加わり、軟調な動きが続いたが、堅調な株価動向なども意識され、底固い動きとなった。

米要人発言

カプラン・ダラス連銀総裁

- ・ 2018 年の基本シナリオは 3 回の利上げ
- ・ 高い債務水準、米経済を金利に対しより敏感にする
- ・ 今年の失業率は 3.7%程度にまで下がるだろう

トランプ米大統領

- ・ 中国とロシアの通貨安誘導、容認できない

ダドリー・NY 連銀総裁

- ・ 貿易障壁が高まれば、米経済にとって悪材料
- ・ 2018 年の追加利上げ、具体的な回数は分からない
- ・ 今年 3 回ないし 4 回が妥当な予測と思われる
- ・ 緩やかな利上げ軌道維持へ

主要な米経済指標結果

3 月米小売売上高(前月比) 0.6% (予想 0.4%・前回 -0.1%)

3 月米小売売上高[除自動車] 0.2% (予想 0.2%・前回 0.2%)

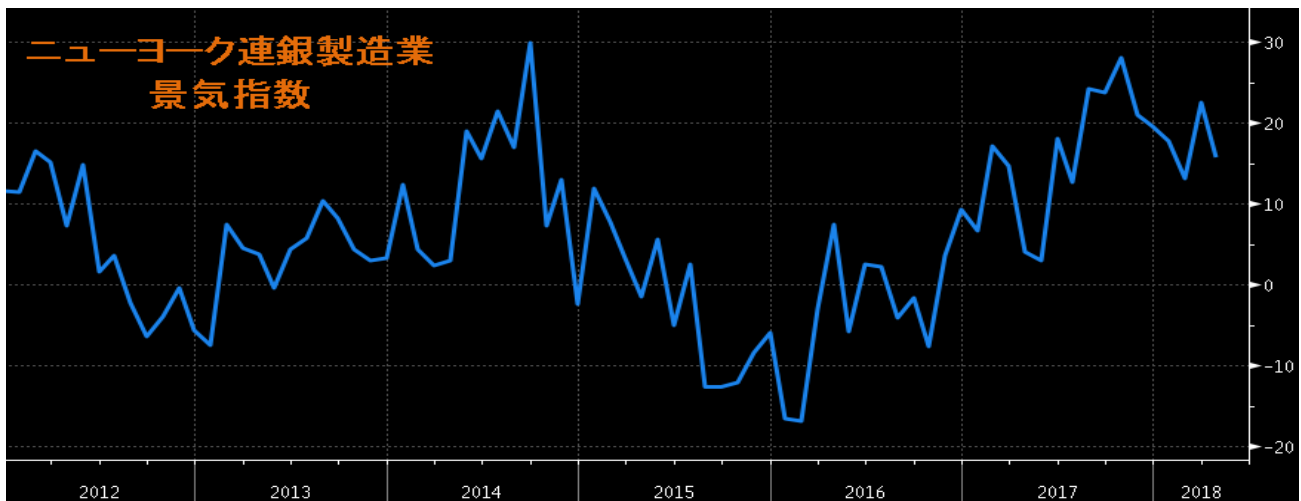
3 月の米小売売上高は、前月比+0.6%の 4945 億 5500 万ドル(約 53 兆円)となり、昨年 11 月以来、4 カ月ぶりのプラスとなった。前年比は+4.5%だった。自動車・同部品が大きく伸びたことが全体の販売を押し上げる要因となった。品目別では、自動車・同部品が+2.0%、インターネット通販など無店舗が+0.8%、ガソリンスタンド-0.3%だった。変動の大きい自動車・同部品を除く売上高は+0.2%、前年比では+4.5%だった。



出所：Bloomberg



4 月ニューヨーク連銀製造業景気指数 15.8 (予想 18.6・前回 22.5)

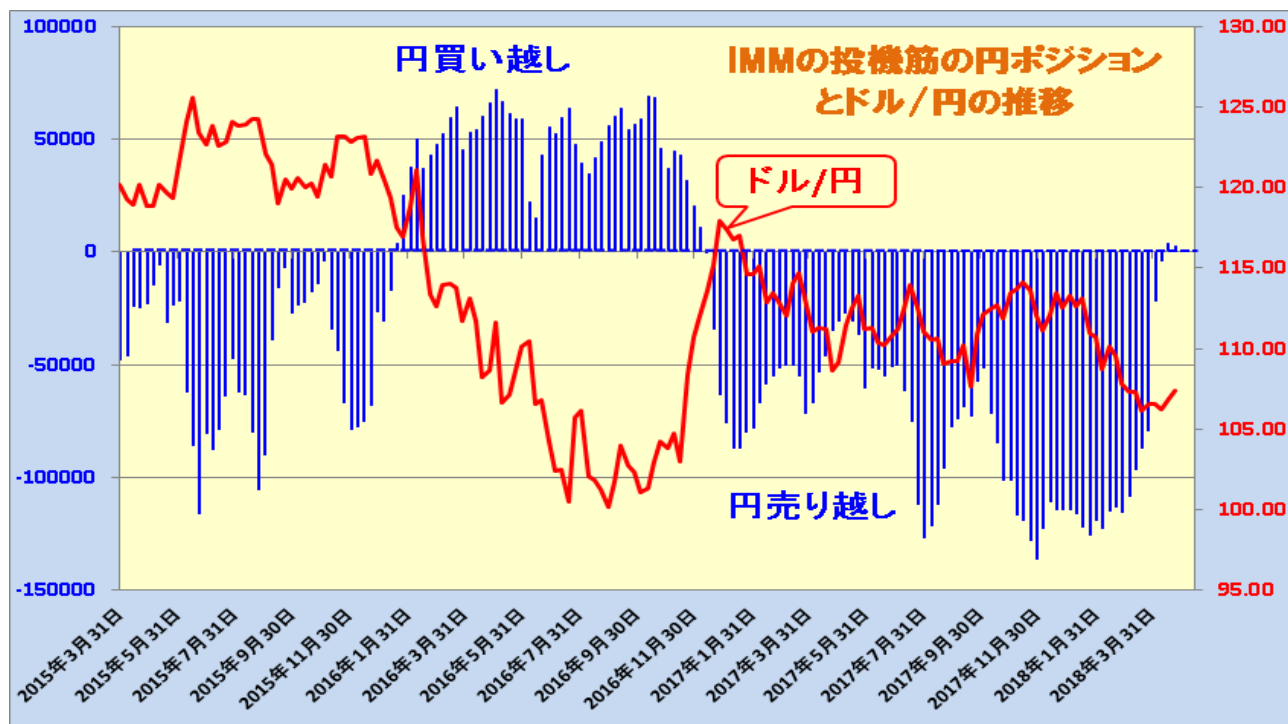


4 月 NAHB 住宅市場指数 69 (予想 70・前回 70)

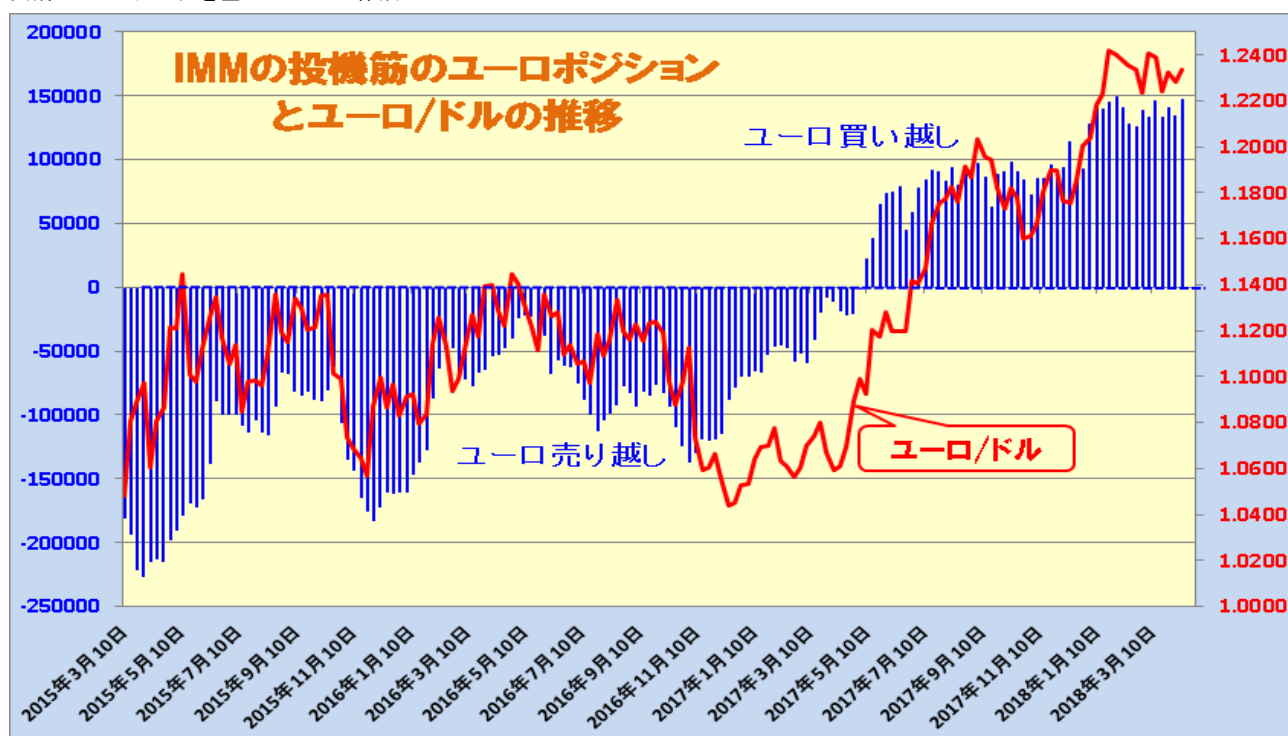


ドルの売り越しは 2011 年 8 月以来の高水準

CFTC（米商品先物取引委員会）の IMM 通貨先物の投機部門の取組（4/10 までの週）では、ドルの売り越しが 2011 年 8 月以来の高水準となった。ドルの主要 6 通貨（円、ユーロ、ポンド、スイスフラン、カナダドル、豪ドル）に対する売り越し額は 227 億 7000 万ドル（前週は 207 億 1000 万ドル）になった。一方、ユーロの買い越しは 14 万 7463 枚に増加し、1 月後半以来の高水準となった。また、円買い越しがやや減少、豪ドルは売り越しが 1 月初旬以来の高水準、そしてポンドの買い越しは 2014 年 7 月以来の高水準となった。



出所：CFTC データを基に SBILM が作成



出所：CFTC データを基に SBILM が作成

米企業決算に対する期待感から堅調な動き

米株式市場は、シリア情勢に対する懸念が和らぎ、買いが先行した。また、米主要企業の四半期決算発表が本格化する中、企業業績への期待感も主要株価の押し上げ要因となった。ダウ平均株価は、序盤から堅調な動きとなり、一時前週末比 315 ドル高まで上昇した。その後は上げ幅を縮小し、212 ドル高で終了した。また、S&P500 は 1 ヶ月ぶりの高値となった。



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	ヘルスケア	1.98%	1	ユナイテッドH	2.69%
2	通信サービス	1.53%	2	メルク	2.59%
3	素材	1.27%	3	ベライゾン	1.53%
4	資本財	0.90%	4	キャタピラー	1.27%
5	テクノロジー	0.81%	5	DowDuPont	1.27%

出所：データを基に SBILM が作成

トランプ大統領のツイートが材料視され、上値の重い動き

NY 市場では、トランプ大統領がツイッターで「ロシアと中国が通貨切り下げゲームを行っている」とし「容認できない」としたことが材料視され、貿易摩擦への懸念が再燃し、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。また、米国債利回りの低下も加わり、ドルは円などの主要通貨に対して軟調な動きが続いた。ただ、米企業の四半期決算に対する期待感を背景に、株価が堅調な動きとなったこともあり、ドル円・クロス円は底固い動きとなった。



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。