

NY マーケットレポート (2018 年 5 月 16 日)

2018年 5月16日 (水)

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	22717.23	-100.79	-0.21%	USD/JPY	110.18	110.39	110.08
ハンセン指数	31110.20	-41.83	3.98%	EUR/JPY	130.54	130.70	130.31
上海総合	3169.57	-22.55	-4.16%	GBP/JPY	148.76	149.10	148.57
韓国総合	2459.82	+1.28	-0.31%	AUD/JPY	82.54	82.55	82.19
豪ASX200	6106.96	+9.14	0.69%	NZD/JPY	75.91	75.91	75.60
インドSENSEX	35387.88	-156.06	3.91%	EUR/USD	1.1847	1.1854	1.1816

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	7734.20	+11.22	0.60%	NY GOLD	1291.50	+1.20	-0.9%
仏CAC40	5567.54	+14.38	4.80%	NY 原油	71.49	+0.18	18.3%
独DAX	12996.33	+26.29	0.61%	COBTコーン	399.25	-3.00	10.9%
スペインIBX35	10111.00	-96.60	0.67%	CRB指数	203.76	+0.307	5.1%
イタリアFTSE MIB	23734.22	-562.95	8.61%	ドル指数先物	93.392	+0.173	1.4%
南ア全株指数	58621.77	+730.00	-1.48%	VIX指数	13.42	-1.21	22.4%

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	24768.93	+62.52	0.20%	USD/JPY	110.35	110.36	110.04
S&P500	2722.46	+11.01	1.83%	EUR/JPY	130.30	130.35	129.54
NASDAQ	7398.30	+46.67	7.17%	GBP/JPY	148.88	149.02	148.19
南北米主要株価	終値	前日比	年初来%	AUD/JPY	82.92	82.93	82.35
トロント総合	16108.06	+10.25	-0.62%	EUR/USD	1.1808	1.1820	1.1763
ボルサ指数	46419.77	+160.80	-5.95%				
ボベスパ指数	86536.97	+1406.55	13.27%				

*一部暫定値

5/17 経済指標スケジュール

08:50 【日本】3月機械受注
08:50 【日本】5月対内外証券投資
09:30 【シンガポール】4月輸出[除石油]
09:30 【シンガポール】4月電子機器輸出
10:00 【オーストラリア】5月消費者インフレ期待
10:30 【オーストラリア】4月失業率
10:30 【オーストラリア】4月雇用者数
10:30 【オーストラリア】4月労働参加率
15:00 【欧州】4月新車登録台数
17:30 【香港】4月失業率
18:00 【欧州】3月建設支出
20:30 【トルコ】3月住宅価格指数
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】5月フィラデルフィア連銀景況指数
21:30 【カナダ】3月国際証券取扱高
23:00 【米国】4月景気先行指標総合指数
23:30 【米国】EIA天然ガス貯蔵量
03:00 【メキシコ】政策金利

5/17 主要会議・講演・その他予定

- ・ ミネアポリス連銀総裁 講演
- ・ ダラス連銀総裁 講演
- ・ 米10年債TIPS債入札

Crypto Currency	本日	前日
CBOE Bitcoin(先物・期近)	8320	8545
CME Bitcoin(先物・期近)	8305	8535
Ripple (BSTP)	0.682	0.700
Ethereum (BSTP)	694.83	712.49
Bitcoin Cash	1260.48	1350.62

*USD 6:00時点

日本国債利回り	本日	前日
2年債	-0.132%	-0.130%
5年債	-0.095%	-0.093%
10年債	0.057%	0.060%
30年債	0.756%	0.753%
欧州国債利回り		
ドイツ10年債	0.606%	0.645%
英国 10年債	1.503%	1.517%
フランス 10年債	0.840%	0.860%
米国債利回り		
2年債	2.585%	2.575%
3年債	2.762%	2.745%
5年債	2.939%	2.919%
7年債	3.061%	3.038%
10年債	3.096%	3.072%
30年債	3.217%	3.201%

NY 市場レポート

« NY 市場概況 »

NY 市場では、序盤に発表された米経済指標の結果がまちまちとなったことから、やや方向感に欠ける動きとなった。また、北朝鮮が米朝首脳会談の中止を警告し、非核化を巡る米朝交渉が緊迫する一方、米 10 年債利回りが 7 年ぶりの高水準となったことなども方向感をつかみ難い要因とされた。一方、イタリアの政局不安が広がったことから、ユーロは、主要通貨に対して軟調な動きが続いたが、米国市場終盤にかけてやや値を戻す動きとなった。

主要な米経済指標結果

4 月住宅着工件数 128.7 万件（予想 131.0 万件・前回 131.9 万件⇒133.6 万件）

4 月建設許可件数 135.2 万件（予想 135.0 万件・前回 135.4 万件⇒137.7 万件）

4 月の米住宅着工件数は、市場予想を下回り、2 カ月ぶりに減少した。前年では+10.5%だった。一戸建て住宅は前月比でプラスだったが、集合住宅が大幅にマイナスとなったことが影響した。一方、着工件数の指標となる建設許可件数は、市場予想を下回り、前月からも減少した。前年比では+7.7%だった。



出所：Bloomberg



出所：Bloomberg

4 月鉱工業生産（前月比） 0.7%（予想 0.6%・前回 0.5%⇒0.7%）

4 月設備稼働率 78.0%（予想 78.4%・前回 78.0%⇒77.6%）

4 月の米鉱工業生産指数は、前月比+0.7%となり、3 カ月連続のプラスとなり、米国の生産活動が堅調に拡大していることが示された。前年比では+3.5%となった。生産指数は、製造業が前月比+0.5%、電力・ガスが+1.9%、鉱業が+1.1%となった。また、4 月の設備稼働率は、前月比 0.4 ポイント上昇の 78.0%となり、過去 20 年間の平均である 80%に近づいた。



出所：Bloomberg



出所：Bloomberg

米要人発言

ボスティック・アトランタ連銀総裁

- ・ 財政刺激は正常化が若干加速する可能性を意味
- ・ 逆イールド起きないようにすることが私の責務
- ・ 利上げ回数については、追加刺激策を考慮し、現在は3度だ
- ・ 中立への回帰に努めるべきだ
- ・ 混乱が生じるほどの速度で行うべきではない
- ・ 金融政策正常化の速度を若干引き上げることが可能であることを意味する
- ・ 当局が予想した賃金の動きはデータに表れていない
- ・ 賃金は若干増加しているが、制御不能な段階ではない
- ・ 賃金が反応していないということは、オーバーシュートしたわけではないことを示唆する

ウィリアムズ・サンフランシスコ連銀総裁

- ・ イールドカーブ懸念しないが、そのシグナルは無視せず
- ・ フォワードガイダンス、段階的廃止必要になるだろう

トランプ米大統領

- ・ 米朝会談、実現の有無把握する必要がある

ブラード・セントルイス連銀総裁

- ・ 追加利上げは予想インフレ率を抑制する可能性
- ・ 利回り曲線逆転させる FED 行動はマイナスのシグナル

米主要株価は上昇も、やや上値の重い動き

米株式市場は、大手百貨店の 2-4 月期決算が市場予想を上回ったことが好感され、主要株価は序盤堅調な動きとなった。ただ、北朝鮮が米朝首脳会談の中止を警告したことや、米期金利の上昇で企業の金利負担増も意識されたことから、上値の重い動きが続いた。ダウ平均株価は、序盤堅調な展開で始まったものの、一時マイナス圏まで下落する動きも見られた。その後は、再び堅調な動きとなり、94 ドル高まで上昇したものの、終盤まで上値の重い動きが続いた。



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	素材	1.31%	1	ナイキ	2.65%
2	消費財	1.22%	2	GE	2.18%
3	ヘルスケア	0.65%	3	ウォルトディズニー	2.06%
4	テクノロジー	0.54%	4	ウォルマート	1.90%
5	消費者サービス	0.36%	5	インテル	1.34%

出所：データを基に SBILM が作成

ドル/円は、やや方向感のつかみ難い展開

NY 市場では、米経済指標の結果がまちまちとなったことから、やや方向感に欠ける動きとなった。また、北朝鮮が米朝首脳会談の中止を警告し、非核化を巡る米朝交渉が緊迫する一方、米 10 年債利回りが 7 年ぶりの高水準となったことなども方向感をつかみ難い要因となった。また、ユーロは、ユーロ圏 GDP が減速したことや、イタリア政局に関して、ポピュリスト政党の議員が ECB 銀行に債務減免を求めることが検討されていると発言したことから懸念が広がり、主要通貨に対して軟調な動きとなった。一方、資源国・新興国通貨はリスク選好の動きから幅広く上昇となり、原油価格の上昇も追い風となった。



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。