

Sumitomo Mitsui Banking Corporation Brazil DAILY MARKET REPORT



Treasury Department

マーケットサマリー

昨日のドルレアルスポット相場は、英国のEU離脱懸念がグローバルなリスクセンチメントの悪化を招く中、ブラジル中銀が急遽ドル売りに相当する通貨スワップのロールオーバー（1枚2千枚＝6億ドル相当、2月限）入札を実施したことでレアル売りに歯止めがかかり、一時3.19台後半までレアル高が進行した。Goldfajn総裁は、Estado紙に対し、「期日が迫ったスワップポジションをロールオーバーしただけであり、スワップに関する方針に変更は何もない」と語った他、ダボス会議に参加中のMeirelles財務相も、Bloomberg社のインタビューに対し、①為替水準に特定のターゲットを有していない、②ロールオーバーは為替市場の流動性を踏まえた判断であり、レアル安がインフレ率に与える影響などは考慮していない、と発言した。一方、マーケットは今回の措置について、「20日に控えているトランプ氏大統領就任式に備えた予防的措置である」との見方を強めている。過去3日間で海外投資家がドル先物の買いポジションを増加させていたことから、米大統領選直後の急激なドル買いの動きを牽制した可能性が指摘されている。

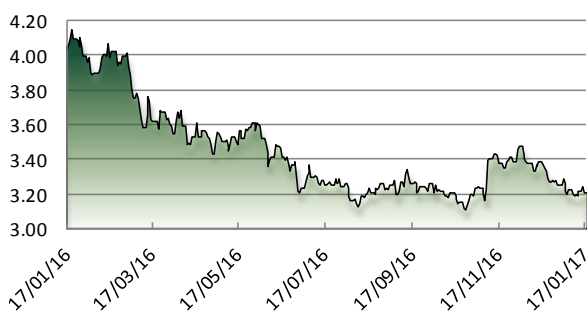
May英首相は昨日、英国がEUの単一市場から撤退し、代わって関税についての合意を目指す考えを表明した。「スムーズで秩序立った離脱を目指す」との見解も示した。なお、同首相はEUとの明確な別離を目指す決意を示すと共に、離脱を巡る最終案を議会の採決にかける方針も公表した。

マーケットデータ

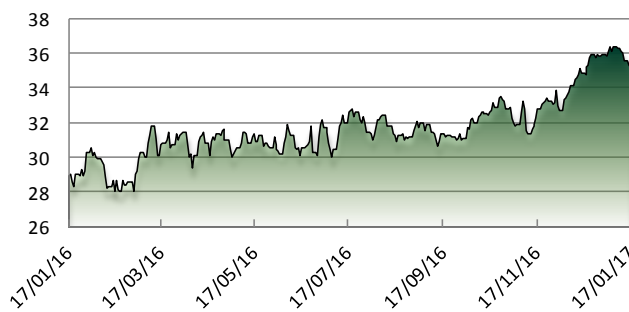
Indicator		Unit	1月16日	1月17日	前日比	12月16日	1ヶ月前比
レアル	対ドル	BRL	3.2414	3.2116	-0.0298	3.3879	-0.1763
	対円	JPY	35.23	35.06	-0.17	34.81	+0.25
	対ユーロ	BRL	3.4367	3.4398	+0.0031	3.5334	-0.0936
円	対ドル	JPY	114.20	112.62	-1.58	117.93	-5.31
	対ユーロ	JPY	121.06	120.65	-0.41	123.22	-2.57
Bovespa（ブラジル株価指数）		Index	63,831	64,354	+523	58,389	+5,965
CDS Brazil 5yrs（クレジットデフォルトスワップ）		bps	252.0	250.4	-1.6	293.1	-42.7
Brazil 10yrs Gov. Bond		%	11.01	11.01	+0.00	11.97	-0.96
DI Future Apr17（金利先物）		%	12.55	12.55	-0.01	13.06	-0.52
3 Months US Dollar Libor		%	1.024	1.024	+0.000	0.997	+0.027
CRB Index（国際商品指数）		Index	194.5	195.1	+0.6	191.4	+3.7

これらのレートは各市場における終了時点の気配値です。実際のレート提示は弊行担当者までお問い合わせ下さい。

ドルレアルスポットチャート



レアル円スポットチャート



<オンブスマン連絡先: 0800 722 2762>

本レポートは情報の提供を目的としており、何らかの行動を喚起するものではありません。ここに示した意見は本レポート作成現在の筆者の意見を示すのみです。データや数値の抽出範囲・基準は任意で設定している場合があります。データ・資料等については、数値等の誤りが含まれている可能性があります。本レポートに基づき、お客様が投資のご判断をされた結果生じた損害・損失については当行は一切責任を負いません。投資や資金運用に関する最終決定は、お客様ご自身で判断されるようお願い申し上げます。本レポートの全部または一部の無断コピー・転載はご遠慮頂きますようお願い申し上げます。