

Sumitomo Mitsui Banking Corporation Brazil DAILY MARKET REPORT



Treasury Department

マーケットサマリー

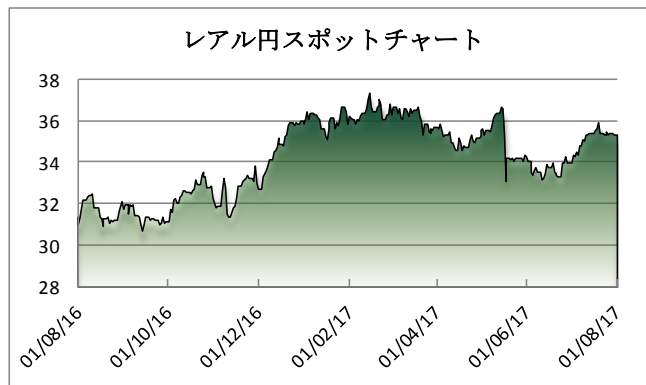
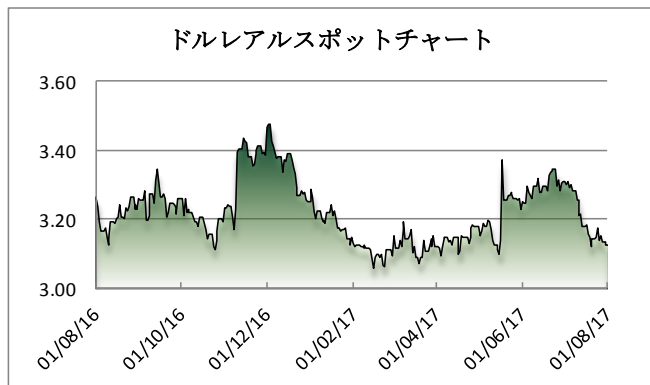
昨日のドルリアルスポット相場は、Temer大統領に対する起訴票決を下院本会議で本日2日に控える中、リアルが一時3.10台後半まで買われたものの、引けにかけてはやや反落し、3.12台半ばで取引を終えた。Globo紙とFolha紙が、「政府は本日票決が実施できるよう努力をしている」と報じている一方、大手コンサルティング会社Eurasiaは、「票決は来週に延期される可能性が高い」との見方を示すなど、依然として票決スケジュールに不透明感が漂っている。同大統領は、野党が(審理を最高裁に移行させるために必要な)342票を確保することは不可能と確信しているが、マーケットは仮に予想通り否決された場合でも、反対票の票数に注目している(概ね、270-280票→ポジティブ、240票以下→ネガティブ、との見方)。大差で反対票を獲得できた場合、その後予定されている年金改革法案を骨抜きにされることなく有利に審議を進展させることができると見込まれるが、僅差であった場合、海外投資家を中心にブラジル資産への失望感が再び拡大することが懸念されている。

ブラジル中銀は昨日、COPOM議事録(7月25-26日開催分)を公表したが、今後の利下げペースに関する文言は声明文と大差なく、次回9月会合で100bpsの追加利下げが実施される可能性が高い。

マーケットデータ

Indicator		Unit	7月31日	8月1日	前日比	1ヶ月前比	(年初来) 高値	(年初来) 安値
リアル	対ドル	BRL	3.1266	3.1263	-0.01%	-5.47%	3.0411	3.4085
	対円	JPY	35.28	35.30	0.06%	3.92%	37.45	32.57
	対ユーロ	BRL	3.7011	3.6906	-0.28%	-2.38%	3.2289	3.7928
円	対ドル	JPY	110.26	110.36	0.09%	-1.81%	108.13	118.60
	対ユーロ	JPY	130.57	130.25	-0.25%	1.44%	114.85	131.40
Bovespa (ブラジル株価指数)		Index	65,920	66,516	0.90%	5.75%	69,488	59,371
CDS Brazil 5yrs		bps	209.90	207.37	-1.21%	-14.45%	281.62	195.45
Brazil 10yrs Gov. Bond		%	9.99	10.01	0.20%	-5.03%	11.77	9.91
DI Future Jan18 (金利先物)		%	8.27	8.23	-0.42%	-8.45%	11.51	8.19
3 Months US Dollar Libor		%	1.3106	1.3106	0.00%	0.89%	1.3167	0.9987
CRB Index (国際商品指数)		Index	182.64	180.76	-1.03%	3.42%	196.36	166.48

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。



<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。