

Sumitomo Mitsui Banking Corporation Brazil DAILY MARKET REPORT



Treasury Department

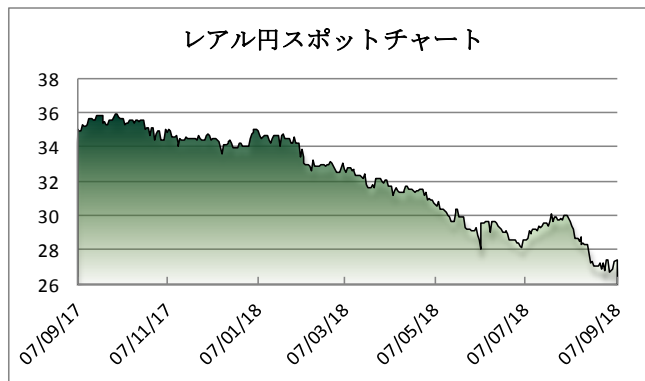
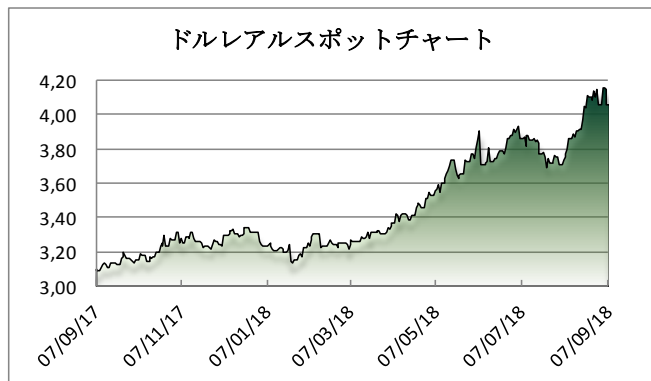
マーケットサマリー

祝日前6日のドルリアルスポット相場は、引けにかけてレアルの買戻しが急速に進行し、4.05台後半で取引を終了。ボベスパ指数も前日比約2%の上昇を記録するなど、ブラジル資産全般がポジティブな反応を示した。Bolsonaro氏が選挙遊説中に刺された事件を今回のマーケットの反応と関連付けることは時期尚早であるものの、左派政権復活への懸念が高まる中で、左派候補者の有力な対抗馬として同氏の台頭をマーケットが肯定的に捉えつつある点は注目に値する。当初、同氏の存在は民営化や民間投資に否定的な発言から海外投資家を中心に恐れられていたが、経済ブレーンとしてシカゴ大学卒のエコノミストPaulo Guedes氏を採用するなど(仮に同氏が大統領選に勝利した場合、Paulo氏は財務相兼予算企画相に指名されると見られる)、マーケットの疑念を除々に払拭することに成功しており、今や改革者の1人としての地位を固めつつある。今回の事件を契機に同氏を「犠牲者」として哀れみ、同情票が集まる可能性も指摘されており、今夜から明日にかけて公表が予定されているDatafolhaとIbopeの最新世論調査の行方に関心が集まっている。一方、労働者党(PT)は、早ければ本日中にもHaddad氏をLula氏に代わる正式候補者に指名すると報じられている。現時点でBolsonaro氏が決選投票まで残るシナリオはかなりの程度相場に織り込まれていると考えられることから、当面の相場展開は、Haddad氏がどの程度Lula氏の支持票を取り込めるか次第、になるであろう。

マーケットデータ

Indicator		Unit	9月6日	9月7日	前日比	1ヶ月前比	(年初来) 高値	(年初来) 安値
レアル	対ドル	BRL	4,0587	4,0587	0,00%	8,17%	3,1210	4,2146
	対円	JPY	27,31	27,37	0,22%	-7,79%	35,13	26,39
	対ユーロ	BRL	4,7115	4,7115	0,00%	8,25%	3,8531	4,9087
円	対ドル	JPY	110,75	110,99	0,22%	-0,35%	104,56	113,39
	対ユーロ	JPY	128,73	128,23	-0,39%	-0,74%	124,62	137,50
Bovespa (ブラジル株価指数)		Index	76.416	76.416	0,00%	-4,89%	88.318	69.069
CDS Brazil 5yrs		bps	281,60	280,40	-0,43%	29,33%	311,85	142,50
Brazil 10yrs Gov. Bond		%	12,16	12,16	0,00%	8,21%	12,60	9,43
DI Future Jan19 (金利先物)		%	6,81	6,81	0,00%	2,18%	7,88	6,21
3 Months US Dollar Libor		%	2,3271	2,3313	0,18%	-0,43%	2,3691	1,6959
CRB Index (国際商品指数)		Index	189,78	190,36	0,31%	-2,13%	206,95	186,74

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。