

Banco Sumitomo Mitsui Brasileiro S.A. DAILY MARKET REPORT



BANCO SUMITOMO MITSUI
BRASILEIRO S.A.

Treasury Department

マーケットサマリー

本日はリアル相場の中長期見通しを記します。

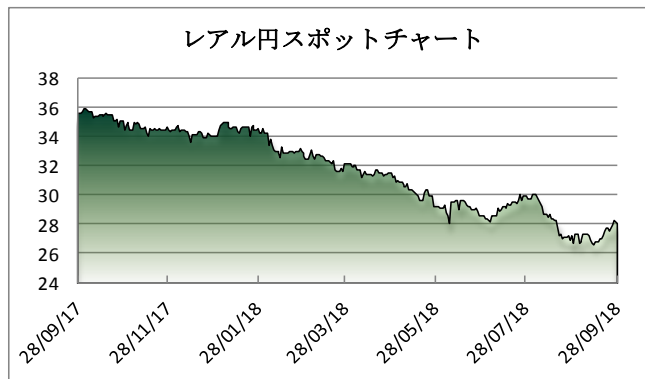
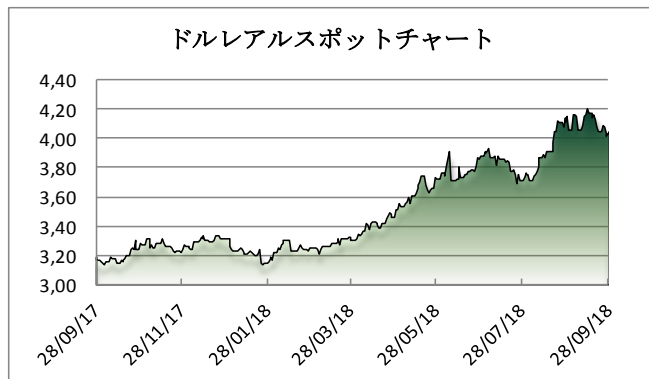
予想レンジ 今後半年 3.80-4.50 今後1年 3.80-4.80

今週末7日によいよ大統領選第1回投票日を迎えるブラジル。先週末28日に公表されたDatafolhaの最新世論調査では、Bolsonaroが28%でリードを維持するも、Haddad氏も前回調査から6%支持率を伸ばして22%を記録。統計上の誤差を含めれば両者の差は僅差である他、決選投票での支持率は反対にHaddad氏が45%と、Bolsonaro氏の39%を上回っている。マーケットは、両者が決選投票に進むシナリオをほぼ織り込んでいることから、今週予定されている各社最終世論調査の結果に大きく反応するとは想定しにくい。7日の第1回投票を終えてHaddad氏が決選投票に残り、労働者党(PT)の復権が現実的となった場合、マーケットがこのまま冷静さを維持できるかどうかは極めて懐疑的である(両者が最終的に現政権の方針を引き継ぎ、マーケットフレンドリーな政権運営に舵を切る、との見方はあまりに楽観的過ぎる)。なお、週末病室からインタビューに応じたBolsonaro氏は、仮に自身が敗退した場合、「そのような選挙結果は信用できない」と述べた。

マーケットデータ

Indicator		Unit	9月27日	9月28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	4,0128	4,0493	0,91%	-2,13%	3,1210	4,2146
	対円	JPY	28,26	28,06	-0,71%	4,41%	35,13	26,39
	対ユーロ	BRL	4,6698	4,7013	0,67%	-2,82%	3,8531	4,9213
円	対ドル	JPY	113,38	113,70	0,28%	2,26%	104,56	114,05
	対ユーロ	JPY	131,99	131,93	-0,05%	1,45%	124,62	137,50
Bovespa (ブラジル株価指数)		Index	80.000	79.342	-0,82%	2,41%	88.318	69.069
CDS Brazil 5yrs		bps	259,00	262,97	1,53%	-9,60%	311,85	142,50
Brazil 10yrs Gov. Bond		%	11,62	11,76	1,20%	-2,79%	12,60	9,43
DI Future Jan19 (金利先物)		%	6,66	6,70	0,53%	-2,05%	7,88	6,21
3 Months US Dollar Libor		%	2,3960	2,3984	0,10%	3,71%	2,3984	1,6959
CRB Index (国際商品指数)		Index	194,17	195,16	0,51%	1,80%	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。