

## 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、週末2日に実施されたブラジル統一地方選において、ルセフ前大統領の所属政党であり汚職問題で揺れる労働者党(PT)が大敗を喫したこと(サンパウロ市長選では、PTで現職のEduardo Haddad氏が、ブラジル社会民主党ーPSDBーのJoao Doria氏に敗北)、レアル買いが加速し、一時3.20割れとなる3.19台後半までレアル高が進行した。ボベスパ指数も前日比1.9%高を記録。ルセフ前大統領の弾劾成立に続き、13年間政権を担ってきたPTの衰退を決定付ける結果となったことで(また、仮に2018年の大統領選にルーラ前大統領が出馬したとしても、PTが復権する可能性は極めて低いとの見方が浮上している)、マーケットはTemer政権が掲げる財政再建策実現への期待感を一層高めており、一部ではレアル相場の3レアル割れを予想する声も聞こえている。目前の注目は、来週10日(あるいは11日)に予定されている歳出上限法案の下院票決の行方に集まっており、賛成多数で可決された場合、ブラジル資産への流入が一層加速するシナリオが想定される。

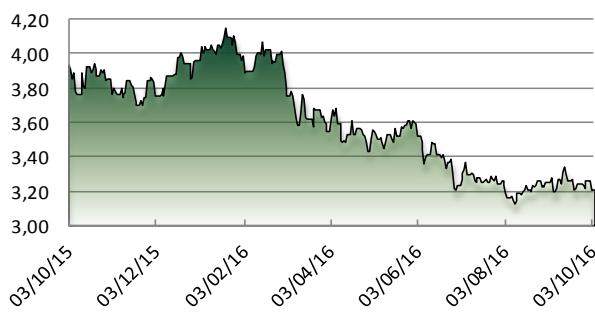
ブラジル中銀が公表した週次サーベイによると、年末の成長率見通しは前週の▲3.14%から不変であったものの、レアル相場見通しが3.29から3.25へ修正された(レアル高方向)。

## ■ マーケットデータ

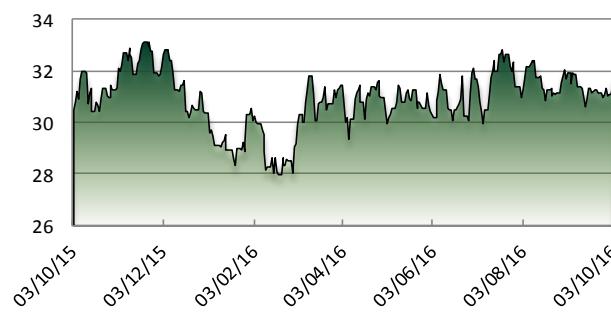
| Indicator                        |      | Unit  | 9月30日  | 10月3日  | 前日比     | 9月2日   | 1ヶ月前比   |
|----------------------------------|------|-------|--------|--------|---------|--------|---------|
| レアル                              | 対ドル  | BRL   | 3,2624 | 3,2099 | -0,0525 | 3,2569 | -0,0470 |
|                                  | 対円   | JPY   | 31,08  | 31,67  | +0,59   | 31,92  | -0,25   |
|                                  | 対ユーロ | BRL   | 3,6673 | 3,5984 | -0,0689 | 3,6329 | -0,0345 |
| 円                                | 対ドル  | JPY   | 101,35 | 101,65 | +0,3000 | 103,92 | -2,2700 |
|                                  | 対ユーロ | JPY   | 113,92 | 113,96 | +0,04   | 115,96 | -2,00   |
| Bovespa (ブラジル株価指数)               |      | Index | 58.367 | 59.461 | +1.094  | 59.616 | -155    |
| CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ) |      | bps   | 273,0  | 267,6  | -5,4    | 258,2  | +9,4    |
| Brazil 10yrs Gov. Bond           |      | %     | 11,58  | 11,51  | -0,07   | 11,99  | -0,48   |
| DI Future Apr17 (金利先物)           |      | %     | 13,32  | 13,24  | -0,08   | 13,58  | -0,34   |
| 3 Months US Dollar Libor         |      | %     | 0,854  | 0,854  | +0,000  | 0,835  | +0,019  |
| CRB Index (国際商品指数)               |      | Index | 186,3  | 187,0  | +0,7    | 180,0  | +7,0    |

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社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



<オンブスマント連絡先: 0800 722 2762>

本レポートは情報の提供目的としており、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。