

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

【為替】

ロシア軍がウクライナ国境周辺に兵力を集結させていることに対し、米国がNATO(北大西洋条約機構)部隊を支援するために米軍部隊(最大8500人)の準備態勢を強化したとの報道を受け、地政学的リスクの高まりから取引開始よりドル高レアル安へ進行。ボルソナロ大統領は2022年予算(793億レアルの赤字)に署名したものの、大統領選を意識したからか、当初予算案対比、支出削減額が小幅となったことに加え、毎週初発表の中銀調査(FOCUS)予測では2022年末のIPCAインフレ率が5.15%に上方修正されたことも嫌気され、一時5.52レアル台までレアル安が進行。その後は、明日に米国FOMCでの金融政策発表を控えて様子見の展開となり、5.50レアルを挟んで小幅な値動きとなった。

【株式】

ロシア・ウクライナ間の緊張の高まりを受けたリスク回避が強まり、ボベスパ指数は取引開始より下落。また、来週から始まる冬季オリンピックを前に北京の大気汚染が悪化したことで、中国当局が唐山の鉄鋼生産拠点に対して減産を命じたことで鉄鉱石価格が下落となり、一時107,000ポイントを割れ込んだ。しかし、同時に下落していた米国株に押し目買いが入ったことで安心感を取り戻すと、指数も108,000ポイント手前まで上昇となり、朝からの下落分を50%戻して取引を終えた。

【中銀調査(毎週初発表)】

- ・IPCA 2022年末:5.15%(前回比:+0.06%)、2023年末:3.40%(前回比:±0.00%)
- ・GDP 2022年末:0.29%(前回比:±0.00%)、2023年末:1.69%(前回比:▲0.06%)
- ・為替 2022年末:5.60レアル(前回比:±0.00レアル)、2023年末:5.50レアル(前回比:0.04レアル安)
- ・Selic 2022年末:11.75%(前回比:±0.00%)、2023年末:8.00%(前回比:±0.00%)

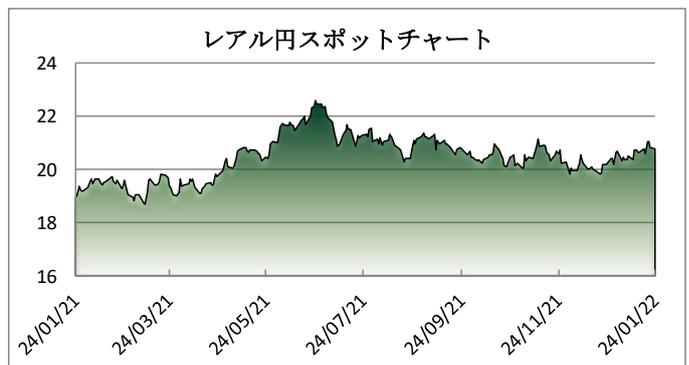
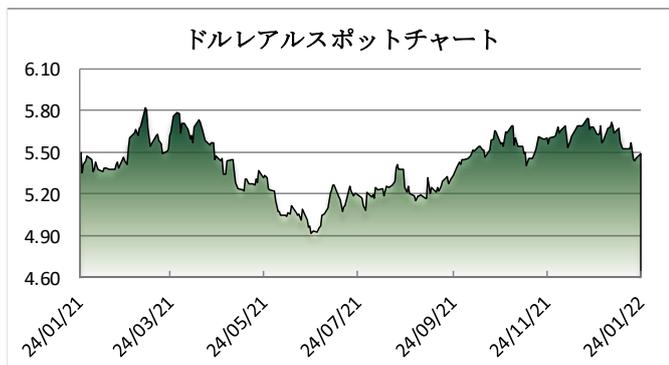
【COVID-19 感染者総数(1/24時点)】

ブラジル全体:24,127,595人(前日比+83,340人)、サンパウロ州感染者数:4,565,699(前日比+2,709人)

マーケットデータ

Indicator		Unit	1月21日	1月24日			(年初来) 高値	(年初来) 安値
					前日比	1ヶ月前比		
レアル	対ドル	BRL	5.4515	5.4909	-0.72%	3.28%	5.3814	5.7247
	対円	JPY	20.83	20.77	0.28%	-3.00%	21.20	20.22
	対ユーロ	BRL	6.1831	6.2181	-0.57%	3.17%	6.0967	6.4749
円	対ドル	JPY	113.68	113.95	-0.24%	0.38%	113.47	116.35
	対ユーロ	JPY	128.98	129.07	-0.07%	0.32%	128.41	131.60
Bovespa (ブラジル株価指数)		Index	108,942	107,937	-0.92%	2.90%	109,873	100,850
CDS Brazil 5yrs		bps	220.59	224.68	-1.85%	-5.77%	227.89	200.64
Brazil 10yrs Gov. Bond		%	11.53	11.51	-0.19%	6.95%	11.57	11.05
DI Future Jan23 (金利先物)		%	11.875	11.810	-0.55%	1.90%	12.14	11.75
SOFR 90日 (Average)		%	0.04967	0.04978	0.22%	1.36%	0.04978	0.04911
CRB Index (国際商品指数)		Index	248.48	245.59	-1.16%	6.36%	250.01	232.37

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。



<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。