

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】

ブラジルの12月最終週のIPCSインフレ率が前月比0.57%（市場予想：0.58%、前回：0.83%）に下落したことを好感し、ドルレアルは取引開始より小幅にレアル高へ進行。しかし、毎週初発表の中銀調査（FOCUS）予測にて、2023年のIPCAインフレ率が悪化したことが嫌気されると、すぐにレアル安へ切り返す展開。また、ボルソナロ大統領が新たな腸閉塞の疑いで緊急入院したことに加え、2022年の最低賃金が1,212レアル/月（2021年：1,100レアル）に引き上げられ、政府の財政負担が410億レアル増加することもあり、財政の先行き懸念が拡大。明日（1月5日）にFOMC議事録の発表を控え、議事録内容によっては市場予想よりも早期に利上げが開始されるとの思惑が広がったことで米国債利回りが上昇すると、終日レアル安の展開となり5.67レアル台にて取引を終えた。

【株式】

ブラジルの12月最終週のIPCSインフレ率が下落したことを好感し、ボベスパ指数は取引開始より上昇。しかし、ボルソナロ大統領が新たな腸閉塞の疑いで緊急入院したことで政治リスクが拡大。更に、バイデン大統領が食品インフレの原因として食肉業界の反競争的慣行を非難したことに加え、食肉加工市場を支配するコングロマリット企業と闘うとの報道を受けて、JBS社等の株価下落と共に一時103,000ポイント台前半まで大幅下落。その後104,000ポイント台半ば迄戻すも、上記財政の先行き懸念により上値は重く、103,000ポイント台後半にて取引を終えた。

【中銀調査（毎週初発表）】

- ・IPCA 2022年末：5.03%（前回比：±0.00%）、2023年末：3.41%（前回比：+0.03%）
- ・GDP 2022年末：0.36%（前回比：▲0.06%）、2023年末：1.80%（前回比：±0.00%）
- ・為替 2022年末：5.60レアル（前回比：±0.00レアル）、2023年末：5.40レアル（前回比：±0.00レアル）
- ・Selic 2022年末：11.50%（前回比：±0.00%）、2023年末：8.00%（前回比：±0.00%）

【COVID-19 感染者総数（1/3時点）※各種報道より】

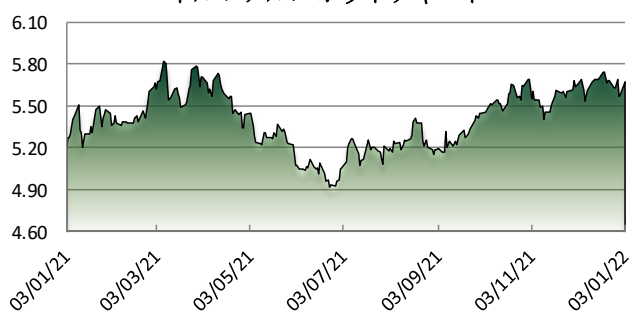
ブラジル全体：22,309,081人（前日比+11,663人）、※サンパウロ州感染者数：4,456,745（前日比+164人）

マーケットデータ

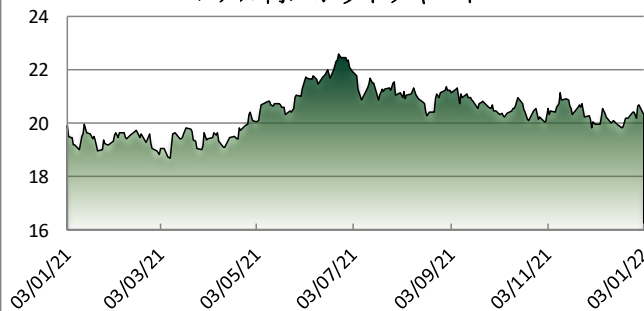
| Indicator | | Unit | 12月31日 | 1月3日 | | | (年初来) 高値 | (年初来) 安値 |
|--------------------------|------|-------|---------|---------|--------|--------|-------------|-------------|
| | | | | | 前日比 | 1ヶ月前比 | | |
| レアル | 対ドル | BRL | 5.5758 | 5.6751 | -1.78% | -0.40% | 5.5601 | 5.6794 |
| | 対円 | JPY | 20.65 | 20.30 | 1.72% | -1.73% | 20.71 | 20.29 |
| | 対ユーロ | BRL | 6.3394 | 6.4106 | -1.12% | -0.28% | 6.3098 | 6.4149 |
| 円 | 対ドル | JPY | 115.08 | 115.32 | -0.21% | -2.23% | 114.95 | 115.37 |
| | 対ユーロ | JPY | 130.90 | 130.28 | 0.47% | -2.07% | 130.02 | 131.00 |
| Bovespa（ブラジル株価指数） | | Index | 104,822 | 103,922 | -0.86% | -1.09% | 106,126 | 103,413 |
| CDS Brazil 5yrs | | bps | 205.25 | 202.46 | 1.36% | 15.01% | 205.89 | 202.25 |
| Brazil 10yrs Gov. Bond | | % | 10.84 | 11.05 | 1.93% | -0.15% | 11.05 | 11.05 |
| DI Future Jan23（金利先物） | | % | 11.795 | 11.790 | -0.04% | 4.24% | 11.90 | 11.75 |
| 3 Months US Dollar Libor | | % | 0.20913 | 0.20913 | 0.00% | 11.46% | 0.2091 | 0.2091 |
| CRB Index（国際商品指数） | | Index | 232.37 | 233.00 | 0.27% | 5.60% | 233.00 | 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行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。