

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・ウクライナ間の地政学的リスクの高まりに加え、ブラジルの1月消費者信頼感が低下したことにより、ドルレアルは取引開始よりリアル安へ進行。米国FOMCも本日に控えて慎重な取引展開が予想されたものの、グローバルでの資産価格の下落を受けて、海外投資家による新興国市場への資金流入が活発となる中、投機的フロー主導でリアル高へ切り返すと、5.45レアル台を割り込む展開。今年は大統領選を控えており、更に新型コロナウイルス変異種(オミクロン株)の感染拡大や、高金利・高物価・高失業率等のファンダメンタルズ(経済の基礎的条件)が良好とは言いにくい環境ではあるものの、その後もリアル高の展開となり、5.44レアル台にて取引を終えた。

【株式】

中国の金融緩和政策への継続期待と旧正月後の鉄鋼需要の高まり期待から鉄鉱石価格が上昇すると、ボベスパ指数は取引開始より上昇。ロシア・ウクライナ間の地政学的リスクの高まりに加え、IMFが2022年の成長率予想を4.4%(前回:4.7%)に下方修正したことにより、108,000ポイント台半ばでは伸び悩む場面もあったが、年始から継続する海外投資家の資金流入(21日迄で201億レアル)にも下支えされ、指数は上昇を継続。原油価格の上昇に因る石油関連株が上昇したこともあり、110,000ポイント台回復して取引を終えた。

【その他】

- ・ブラジル1月消費者信頼感: 74.1ポイント(市場予想: 無し、前月: 75.5ポイント)
- ・米国11月住宅価格指数(前月比): 1.1%(市場予想: 1.0%、前月: 1.1%)
- ・米国1月消費者信頼感: 113.1ポイント(市場予想: 111.2ポイント、前月: 115.2ポイント)

【COVID-19 感染者総数(1/25時点)】

ブラジル全体: 24,311,317人(前日比+183,722人)、サンパウロ州感染者数: 4,578,916(前日比+13,217人)

マーケットデータ

| Indicator | Unit | 1月24日 | 1月25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 | 5.4909 | 5.4412 | 0.91% | 4.16% | 5.3814 | 5.7247 |
| | 対 円 | JPY | 20.77 | 20.92 | -0.75% | -3.78% | 21.20 | 20.22 |
| | 対 ユーロ | BRL | 6.2181 | 6.1514 | 1.07% | 4.21% | 6.0967 | 6.4749 |
| 円 | 対 ドル | JPY | 113.95 | 113.88 | 0.06% | 0.44% | 113.47 | 116.35 |
| | 対 ユーロ | JPY | 129.07 | 128.70 | 0.29% | 0.61% | 128.25 | 131.60 |
| Bovespa (ブラジル株価指数) | Index | 107,937 | 110,204 | 2.10% | 5.06% | 110,711 | 100,850 | |
| CDS Brazil 5yrs | bps | 224.68 | 224.98 | -0.13% | -5.91% | 227.89 | 200.64 | |
| Brazil 10yrs Gov. Bond | % | 11.51 | 11.43 | -0.74% | 6.16% | 11.57 | 11.05 | |
| DI Future Jan23 (金利先物) | % | 11.810 | 11.835 | 0.21% | 2.11% | 12.14 | 11.75 | |
| SOFR 90日 (Average) | % | 0.04978 | 0.04967 | -0.22% | 1.14% | 0.04978 | 0.04911 | |
| CRB Index (国際商品指数) | Index | 245.59 | 248.78 | 1.30% | 7.75% | 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



〈オンライン接続先: 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。