

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】

COPOMの政策金利発表にて断続的な利上げが予想される中、投機フローに因り2020年6月以来の5.00レアル割れをトライ一時4.99レアル迄レアル高が進行。しかし、米国FOMCではフェデラルファンド(FF)金利誘導目標レンジが0-0.25%に据え置きされたものの、資産購入規模(現在1,200億ドル/月)の縮小について議論を始めたことを明らかにした他、FRBメンバーの18人中11人が2023年末迄に少なくとも2回の利上げを予想したこと、米国債金利が上昇し、5.08レアル台まで戻す展開となった。尚、COPOM(取引時間終了後)では、Selicレートを0.75%引き上げ、4.25%とすることを全会一致で決定(3会合連続)。声明文では中立金利までの利上げを示唆し、次回会合(8月4日)も同規模の利上げを実施予定とした。

【株式】

中国の5月小売売上高と鉱工業生産が市場予想比・前月比共に下回ったことや、中国政府が原材料価格の上昇抑制のために国有企业宛にコモディティトレーディングの監視強化を発表したことで価格が伸び悩み、ボベスバ指数も取引開始より下落。FOMCにて早期利上げの可能性が示唆されると、金利上昇(調達金利上昇)が嫌気され128,000ポイント台前半まで下落、その後、上院でのエレトロプラス社民営化法案の投票が木曜日(本日)に実施されるとの報道に因り上昇するも、130,000ポイントには届かず、129,000ポイント台前半で取引を終えた。

【その他】

- ・中国5月小売売上高(前年比): 12.4%(市場予想: 14.0%、前月: 17.7%)

- ・中国5月鉱工業生産(前年比): 8.8%(市場予想: 9.2%、前月: 9.8%)

- ・FOMC: フェデラルファンド(FF)金利誘導目標レンジを0-0.25%で据え置き。資産購入金額も据え置き(1,200億ドル/月)

GDP予想(中心): 2021年7.0%、2022年3.3%、2023年2.4%

PCE予想(中心): 2021年3.4%、2022年2.1%、2023年2.2%

- ・COPOM声明文: 国内経済は予想以上に堅調であり、景気回復へのリスクは大幅に軽減された。物価上昇圧力は、特に工業製品において予想以上に大きい。更に、茲許のレアル高進行にも関わらず、供給の遅れ・需要回復の遅れ・水害(水不足)に因る電力料金引上げが短期的に影響している。現時点で、政策金利を中立的なレベルにまで正常化することが適切と判断。

【COVID-19 感染者総数(6/16時点)】

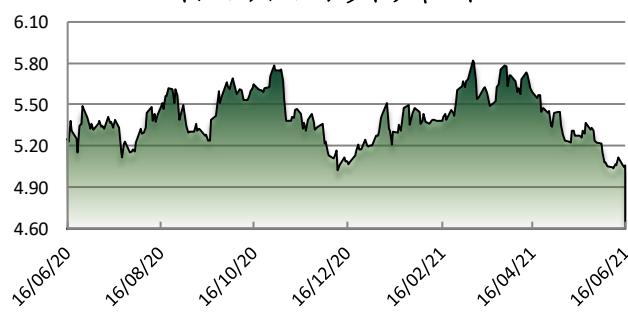
ブラジル全体: 17,628,588人(前日比+95,367人)、サンパウロ州: 3,509,967人(前日比+22,582人)

マーケットデータ

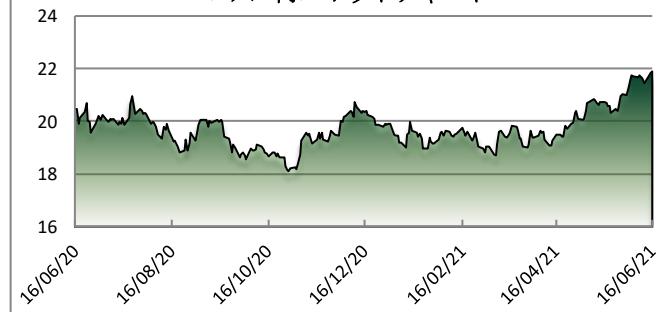
Indicator	Unit	6月15日	6月16日			(年初来) 高値	(年初来) 安値	
				前日比	1ヶ月前比			
レアル	対 ドル	BRL	5.0457	5.0549	-0.18%	4.14%	4.9933	5.8743
	対円	JPY	21.81	21.90	-0.38%	-5.58%	22.02	18.48
	対ユーロ	BRL	6.1188	6.0646	0.89%	5.30%	6.0484	6.9845
円	対 ドル	JPY	110.08	110.71	-0.57%	-1.24%	102.59	110.97
	対ユーロ	JPY	133.49	132.79	0.52%	-0.01%	125.09	134.13
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	130,091	129,260	-0.64%	6.05%	131,190	107,319	
CDS Brazil 5yrs	bps	163.21	164.22	-0.62%	6.61%	232.63	141.37	
Brazil 10yrs Gov. Bond	%	9.16	9.14	-0.21%	-3.10%	9.62	6.87	
DI Future Jan22 (金利先物)	%	5.380	5.430	0.93%	9.70%	5.45	2.82	
3 Months US Dollar Libor	%	0.12475	0.12450	-0.20%	-19.74%	0.2413	0.1180	
CRB Index (国際商品指数)	Index	210.18	210.17	-0.00%	3.38%	212.51	166.34	

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



〈オフィスマン連絡先: 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。