

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】

ブラジル政府は税制改革の第二弾(法人税見直し、個人の所得税控除の拡大、受取配当金への新規課税)を下院に提出したものの、第一弾(製造業に課される税の統一化)が1年以上議論されるも膠着状態が継続している背景から、相場への影響は限定的。また、ブラジルの6月IPCA-15インフレ率は市場予想を下回るも前月より大幅に上昇し、利上げの継続が意識される一方、米国の経済指標(特に個人支出やミシガン大学消費者マインド)は市場予想に比べて伸びが低迷したことで、加熱していた米国の先行き経済回復期待と早期利上げ期待が一時緩和され、取引開始より4.90台前半での推移。その後、2022年大統領選に関する世論調査(調査期間:6月17日-21日)にて、ルーラ元大統領への支持率は49%・ボルソナロ大統領支持は23%と改革進展の遅れや財政悪化の懸念が浮上し、一時4.97レアル台までレアル安へ進行。しかし、米国で(金曜の各種経済指標を受けて)FRBが利上げを急ぐことはないと見方があがり米国債金利が低下すると、4.93レアル台までドル安レアル高が進行して取引を終えた。

【株式】

ブラジルの6月IPCA-15インフレ率の上昇継続により、ブラジル中銀による積極的な利上げが実施されるとの予想が維持される中、金利上昇が嫌気されボベスパ指数は緩やかに下落。2022年大統領選に関する世論調査でもボルソナロ大統領支持がルーラ元大統領支持を大幅に下回る結果となり改革進展の遅れや財政悪化懸念が拡大、127,000ポイント台まで下落となった。

【その他】

- ・ブラジル6月IPCA-15インフレ率(前月比): 0.83%(市場予想: 0.85%、前月: 0.44%)
(前年比): 8.13%(市場予想: 8.16%、前月: 7.27%)
- ・ブラジル5月経常収支: 3,840百万ドル(市場予想: 3,800百万ドル、前月: 5,359百万ドル)
- ・米国5月個人所得(前月比): ▲2.0%(市場予想: ▲2.5%、前月: ▲13.1%)
- ・米国5月個人支出(前月比): 0.0%(市場予想: 0.4%、前月: 0.9%)
- ・米国6月ミシガン大学消費者マインド: 85.5ポイント(市場予想: 86.5ポイント、前月: 86.4ポイント)

【COVID-19 感染者総数(6/27時点)】

ブラジル全休: 18,420,598人(前日比+33,704人)、サンパウロ州: 3,696,093人(前日比+7,965人)

マーケットデータ

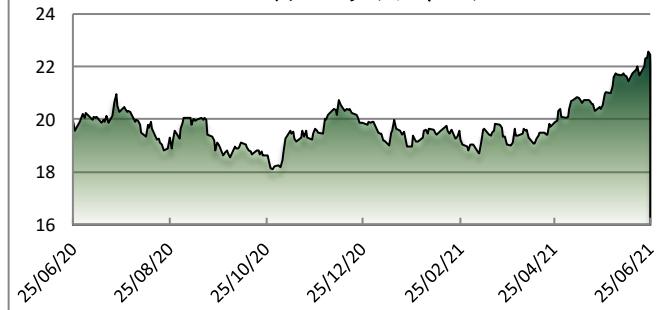
Indicator	Unit	6月24日	6月25日			(年初来) 高値	(年初来) 安値	
				前日比	1ヶ月前比			
レアル	対ドル	BRL	4.9146	4.9343	-0.40%	7.45%	4.8934	5.8743
	対円	JPY	22.56	22.45	0.49%	-10.07%	22.63	18.48
	対ユーロ	BRL	5.8633	5.8888	-0.43%	9.86%	5.8459	6.9845
円	対ドル	JPY	110.87	110.75	0.11%	-1.81%	102.59	111.12
	対ユーロ	JPY	132.28	132.25	0.02%	0.75%	125.09	134.13
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	129,514	127,256	-1.74%	3.47%	131,190	107,319	
CDS Brazil 5yrs	bps	160.18	158.60	0.98%	10.85%	232.63	141.37	
Brazil 10yrs Gov. Bond	%	9.18	9.20	0.13%	-2.10%	9.62	6.87	
DI Future Jan22 (金利先物)	%	5.725	5.695	-0.52%	14.01%	5.78	2.82	
3 Months US Dollar Libor	%	0.14600	0.14600	0.00%	5.42%	0.2413	0.1180	
CRB Index (国際商品指数)	Index	209.51	210.42	0.43%	3.94%	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



<オンライン相談連絡先: 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。