

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】

先週金曜日にCPI(コロナ調査委員会)にてルイス・ミランダ議員がインド製の新型コロナウイルスワクチンCovaxinの購入を巡り、ボルソナロ政権にて不正・汚職の可能性があると指摘したこと(政府は否定)を嫌気し、取引開始より4.97レアル台までレアル安が進行。毎週月曜日発表の中銀調査(FOCUS)では2021年末インフレ率予想が5.97%(前回5.90%)と上方修正されたものの、2022年末は2週連続で3.78%を維持したことで安心感が拡大し、レアル高へ。ただし、税制改革の第二弾(所得税規則の変更案)を巡り、実質的に法人税の増税懸念が専門家の間で指摘されていることや、前述のワクチン購入に関する不安定な政治リスクが意識され、4.92レアル後半にて取引を終えた。

【株式】

中銀調査(FOCUS)で2021年末のGDP予想が5.05%(前回5.00%)に上方修正されたことを受けてボベスパ指数は取引開始より128,000ポイント台まで上昇。しかし、税制改革の第二弾において実質的な法人税の増税懸念が拡大したことやワクチン購入を巡る政治リスクの拡大を受けて下落。その後も、税制改革議論を見極める姿勢が広がり、127,000ポイントを挟んで小幅な値動きとなつた。

【中銀調査(毎週初発表)】

- IPCA 2021年末: 5.97% (前回比+0.07%)、2022年末: 3.78% (前回比±0.00%)
- 為替 2021年末: 5.10レアル (前回比±0.00レアル)、2022年末: 5.20レアル (前回比±0.00レアル)
- GDP 2021年末: 5.05% (前回比+0.05%)、2022年末: 2.11% (前回比+0.01%)
- Selic 2021年末: 6.50% (前回比±0.00%)、2022年末: 6.50% (前回比±0.00%)

【COVID-19 感染者総数(6/28時点)】

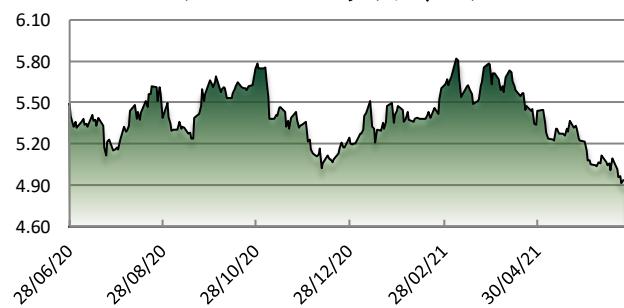
ブラジル全体: 18,448,402人 (前日比+27,804人)、サンパウロ州: 3,648,202人 (前日比+17,951人)

マーケットデータ

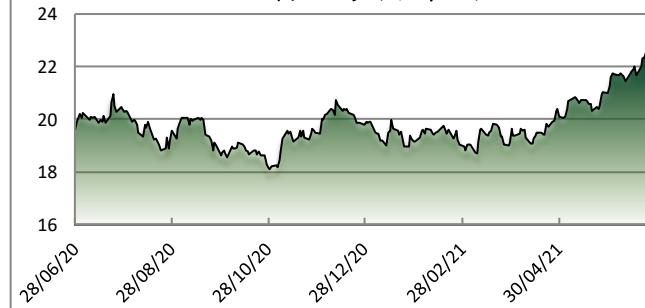
Indicator	Unit	6月25日	6月28日			(年初来) 高値	(年初来) 安値	
				前日比	1ヶ月前比			
レアル	対ドル	BRL	4.9343	4.9266	0.16%	5.72%	4.8934	5.8743
	対円	JPY	22.45	22.45	0.03%	-6.76%	22.63	18.48
	対ユーロ	BRL	5.8888	5.8757	0.22%	7.78%	5.8459	6.9845
円	対ドル	JPY	110.75	110.63	0.11%	-0.71%	102.59	111.12
	対ユーロ	JPY	132.25	131.96	0.22%	1.47%	125.09	134.13
Bovespa (ブラジル株価指数)		Index	127,256	127,429	0.14%	1.49%	131,190	107,319
CDS Brazil 5yrs		bps	158.60	159.16	-0.35%	7.41%	232.63	141.37
Brazil 10yrs Gov. Bond		%	9.20	9.13	-0.75%	0.05%	9.62	6.87
DI Future Jan22 (金利先物)		%	5.695	5.635	-1.05%	12.03%	5.78	2.82
3 Months US Dollar Libor		%	0.14600	0.14725	0.86%	12.08%	0.2413	0.1180
CRB Index (国際商品指数)		Index	210.42	210.94	0.25%	2.55%	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。