

Banco Sumitomo Mitsui Brasileiro S.A. DAILY MARKET REPORT



Treasury Department

マーケットサマリー

為替

毎週初発表の中銀調査(FOCUS)で2021年GDP見通しが3.96%(前週:3.52%)と大幅に上方修正されたことに加え、IPCAインフレ率見通しが5.31%(前週:5.24%)と物価上昇が継続、Selicレート見通しも5.75%まで上昇したことでレアル金利上昇し、取引開始よりレアル高が進行。さらに、4月の基礎的財政収支が243億レアル(市場予想:172億レアル、3月:50億レアル)となったことや、4月の純債務対GDP比が60.5%(市場予想:61.4%、3月:61.3%)と、財政悪化に歯止めがかかった結果を好感し、一時5.19レアル台に達した。月末決済のドル買いフローに押され5.26レアルまでレアル安が進行するも、ロベルト・カンボス・ネット中銀総裁が「ブラジルは新型コロナウイルス感染の第2波の中でも経済活動は予想比良好」と発言したことや、ボルソナロ大統領が「現在60件、総額約720億ドルの投資プロジェクトがあり、国は500億ドルの投資収入がある見込み。2022年迄に22,000人の雇用を生み出すだろう」と発言したことが好感され、5.21レアル台まで戻して取引を終えた。

【株式】

アジア市場で再び鉄鉱石価格が上昇したことや、前述の中銀調査(FOCUS)でのGDP予想上昇を受けてボベスパ指数は取引開始より上昇。ブラジル保健当局が米ファイザー社製ワクチンの使用対象を12~15歳まで拡大することを検討していると発表を受けて、ワクチン接種進展期待が拡大。しかし、米国・英国市場が休日となり流動性が低い中、上昇も限定的となり、126,000ポイント前半まで取引を終えた。

【中銀調査(毎週初発表)】

- ・IPCA 2021年末:5.31%(前回比+0.07%)、2022年末:3.68%(前回比+0.01%)
- ・為替 2021年末:5.30レアル(前回比±0.00レアル)、2022年末:5.30レアル(前回比±0.00レアル)
- ・GDP 2021年末:3.96%(前回比+0.44%)、2022年末:2.25%(前回比▲0.05%)
- ・Selic 2021年末:5.75%(前回比+0.25%)、2022年末:6.50%(前回比+±0.00%)

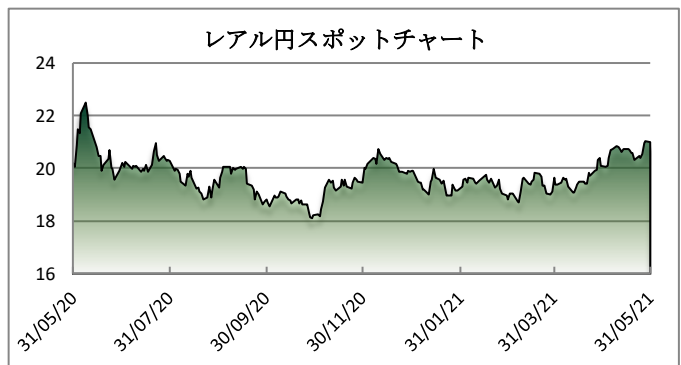
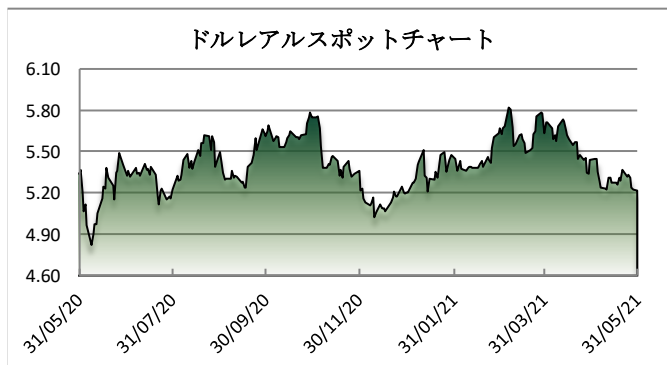
【COVID-19 感染者総数(5/31時点)】

ブラジル全体:16,545,554人(前日比+30,434人)、サンパウロ州:3,272,043人(前日比+6,113人)

マーケットデータ

Indicator	Unit	5月28日	5月31日	5月31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	5.2257	5.2188	0.13%	4.02%	5.1210	5.8743
	対円	JPY	21.03	21.00	0.14%	-4.45%	21.09	18.48
	対ユーロ	BRL	6.3713	6.3819	-0.17%	2.38%	6.2961	6.9845
円	対ドル	JPY	109.85	109.58	0.25%	-0.25%	102.59	110.97
	対ユーロ	JPY	133.93	133.97	-0.03%	-1.96%	125.09	134.09
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	125,561	126,216	0.52%	6.16%	126,216	107,319	
CDS Brazil 5yrs	bps	171.89	171.77	0.07%	10.56%	232.63	141.37	
Brazil 10yrs Gov. Bond	%	9.12	9.13	0.08%	0.05%	9.62	6.87	
DI Future Jan22 (金利先物)	%	5.030	5.060	0.60%	8.70%	5.09	2.82	
3 Months US Dollar Libor	%	0.13138	0.13138	0.00%	-25.51%	0.2413	0.1314	
CRB Index (国際商品指数)	Index	205.70	205.70	0.00%	2.97%	209.52	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。



<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。