

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

昨日のマーケットはFOMCとCOPOMの前日であったため特段大きな変動無く、ドルレアルは3.78台での推移となった。金利のイールドカーブはやや低下しながらも安定した推移となっており、Selicの0.50%利下げを織り込んだ水準を維持している。ブルームバーグのエコノミスト調査では、Selicの現状維持予想が2人、0.25%の利下げ予想が24人、0.50%の利下げ予想が18人となっており、本日の発表を待っている。ボベスパ指数はイタウ銀行の第2Q決算を受けて銀行関連が指数の低下を牽引する一方で、小売業は金利の低下や低インフレ、政府の政策期待によって上昇しており、強弱入り混じる展開となった。米国株式は米中貿易交渉のシナリオが不透明であることを背景に下落。トランプ大統領が中国に対して批判的なコメントを出しておらず、両国代表が貿易交渉を再開しようとしているタイミングで関係悪化懸念が広がり、午後はドルインデックスも緩やかに低下となった。

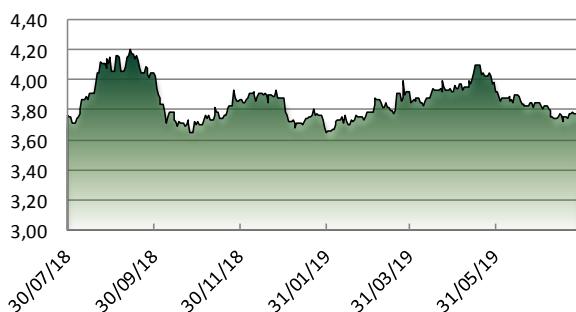
マーケットは新たな金融緩和サイクルの開始の期待が高まっており、短期的に国内株式や資金調達ニーズが高い企業にとっては追い風となっている。マーケットも債券からヘッジファンドやエクイティファンド等に資金の流れが加速しており、金融緩和がブラジル国内株式の動きを活発化させると予想している。

マーケットデータ

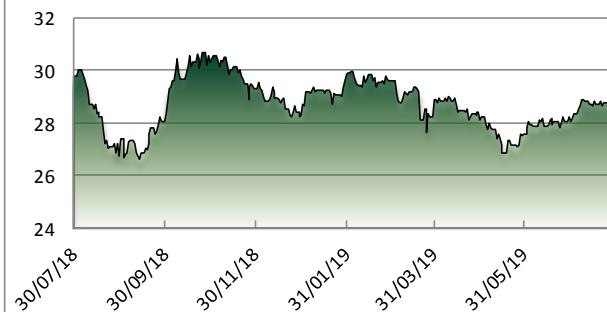
Indicator		Unit	7月29日	7月30日	前日比	1ヶ月前比	(年初来) 高値	(年初来) 安値
レアル	対ドル	BRL	3,7818	3,7908	0,24%	-1,54%	3,6374	4,1217
	対円	JPY	28,77	28,65	-0,42%	2,20%	30,08	26,68
	対ユーロ	BRL	4,2148	4,2295	0,35%	-3,37%	4,1646	4,6037
円	対ドル	JPY	108,78	108,61	-0,16%	0,70%	104,87	112,40
	対ユーロ	JPY	121,21	121,15	-0,05%	-1,23%	118,71	127,50
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index		103.483	102.933	-0,53%	1,95%	106.650	87.536
CDS Brazil 5yrs	bps		125,10	126,44	1,07%	-15,93%	209,52	124,06
Brazil 10yrs Gov. Bond	%		7,22	7,20	-0,28%	-3,38%	9,34	7,18
DI Future Jan20 (金利先物)	%		5,59	5,56	-0,45%	-7,02%	6,69	5,56
3 Months US Dollar Libor	%		2,25550	2,25313	-0,11%	-2,88%	2,8039	2,2555
CRB Index (国際商品指数)	Index		177,80	178,34	0,30%	-1,49%	189,68	168,26

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



<オプスマン連絡先: 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。