

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】

本日のCOPOMで0.75%の利上げ予想がされるなかレアル金利が上昇するも、堅調な米国経済回復を受けて利上げ前倒しの思惑が広がり、米国金利の上昇と共にドル高レアル安が進行。一時5.48レアルを記録するも、税制改革草案に3,000億レアル相当の免税削減が盛り込まれていたことで財政改善期待が拡大したことや、パウロ・ゲデス経済相が「現在の物価上昇は為替の影響が大きい。均衡為替レートは現在ほどドル高水準ではない為、今後下落(レアル高)となるだろう」と発言したことでレアル高に転じた。しかし、CPI(コロナ調査委員会)でマンデッタ元保健相が新型コロナウイルス感染拡大について「外務省と中国の関係が悪く、ワクチンの購入が遅延した。本来であればブラジルは2020年11月からワクチン接種が可能だった」と政府批判をしたことで政治不透明感が拡大、また、COPOMを控えて様子見が強まる中、5.42レアルで取引を終えた。

【株式】

前日夜に発表されたイタウ銀行の第1四半期決算が64億レアルと前年同期比+64%となったものの、前日上昇した銀行株含め上昇は一時的との見方が強まったことで銀行株主導でボベスバ指数は下落。更に前述のマンデッタ元保健相の発言を受けて政治不透明感が拡大したことにより、夕方にアーチー・リラ院議長が税制改革委員会を解散し、新たな委員会を設置することを発表したことで改革進展期待が後退し、117,000ポイント台後半まで下落した。

【その他】

- ・**・** ブラジル3月PPI(生産者物価指数)(前月比): 4.81%(市場予想: 無し、前月: 3.72%)
(前年比): 29.15%(市場予想: 無し、前月: 25.42%)

- ・米国3月製造業受注(前月比): 1.1%(市場予想: 1.3%、前月: ▲0.5%)

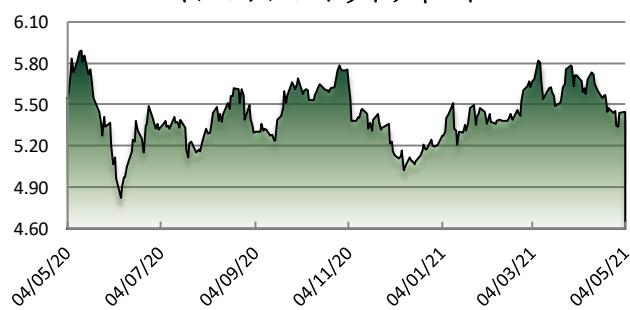
【COVID-19 感染者総数(5/4時点)】

ブラジル全体: 14,856,888人(前日比+77,359人)、サンパウロ州: 2,941,980人(前日比+15,464人)

マーケットデータ

Indicator	Unit	5月3日	5月4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	5.4427	5.4435	-0.01%	4.65%	5.1210
	対円	JPY	20.04	20.08	-0.18%	-3.55%	20.43
	対ユーロ	BRL	6.5648	6.5394	0.39%	2.74%	6.2961
円	対ドル	JPY	109.07	109.33	-0.24%	1.23%	102.59
	対ユーロ	JPY	131.60	131.34	0.20%	-0.90%	125.09
Bovespa (ブラジル株価指数)		Index	119,210	117,712	-1.26%	2.13%	125,324
CDS Brazil 5yrs		bps	192.89	195.04	-1.11%	13.15%	232.63
Brazil 10yrs Gov. Bond		%	9.18	9.34	1.83%	-0.87%	9.62
DI Future Jan22 (金利先物)		%	4.735	4.795	1.27%	3.68%	4.89
3 Months US Dollar Libor		%	0.17638	0.17538	-0.57%	-12.20%	0.2413
CRB Index (国際商品指数)		Index	200.85	202.45	0.80%	8.43%	203.10
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。