

Banco Sumitomo Mitsui Brasileiro S.A. DAILY MARKET REPORT



Treasury Department

マーケットサマリー

【為替】

ブラジル保健省の局長がアストラゼネカ社製の新型コロナウイルスワクチンの購入交渉において、薬品供給会社宛の賄賂(1ドル/1回投与、4億回分)を要求したと告発されたことに加え、Covaxin(インドの新型コロナウイルスワクチン)購入時も口止め料として賄賂を要求していたことが明らかとなったことで、政治の不透明感が高まり取引開始よりレアル安へ進行。更に、米国の6月ADP雇用統計が市場予想比良好な結果となったことや、四半期末決済に伴うドル買いフローも入ったことで、一時5.02レアルを記録。しかし、農作物価格(大豆、トウモロコシ、小麦等)や原油価格の上昇に加え、電気料金の値上げを受けた物価上昇の可能性が高まったことで、レアル金利(特に短期)は上昇し、4.96レアル台までレアル高へ進行して取引を終えた。

【株式】

上記ワクチン購入を巡る汚職懸念に伴う政治への不透明感が高まる中、ボベスパ指数は取引開始より下落。また米国の外資系証券会社が「現在議会で議論されている税制改革案が承認された場合、金融・エネルギー関連企業を中心にマイナスの影響となり、ブラジル株式市場は4.1%下落する可能性がある」と発表したことが嫌気され、一時126,000ポイント前半まで下落。一方、行き詰まりが長引く米国とイランの核交渉について、仮にイランへの制裁措置が緩和されてもイラン産原油の生産量は少量となるとの見方が広がったことで、原油先物価格は上昇。ボベスパ指数も上昇に転じるも、税制改正とワクチン購入に関する不確実性が残る中、上昇幅は限定的となり、126,000ポイント後半にて取引を終えた。

【その他】

- ・ブラジル4月失業率: 14.7%(市場予想: 14.7%、前月: 14.7%)
- ・ブラジル5月純債務GDP比: 59.7%(市場予想: 60.7%、前月: 60.5%)
- ・米国6月ADP雇用統計: 692千人(市場予想: 600千人、前月: 886千人)

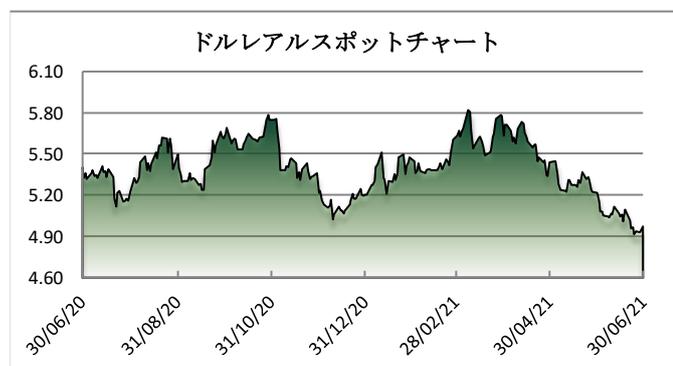
【COVID-19 感染者総数(6/30時点)】

ブラジル全体: 18,557,141人(前日比+43,836人)、サンパウロ州: 3,727,348人(前日比+7,762人)

マーケットデータ

Indicator	Unit	6月29日	6月30日	6月30日		(年初来)	(年初来)	
				前日比	1ヶ月前比	高値	安値	
レアル	対ドル	BRL	4.9565	4.9696	-0.26%	4.90%	4.8934	5.8743
	対円	JPY	22.30	22.36	-0.27%	-6.37%	22.63	18.48
	対ユーロ	BRL	5.8973	5.8913	0.10%	7.53%	5.8459	6.9845
円	対ドル	JPY	110.53	111.11	-0.52%	-1.15%	102.59	111.12
	対ユーロ	JPY	131.48	131.75	-0.21%	1.63%	125.09	134.13
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	127,327	126,802	-0.41%	0.99%	131,190	107,319	
CDS Brazil 5yrs	bps	160.78	164.79	-2.50%	4.13%	232.63	141.37	
Brazil 10yrs Gov. Bond	%	9.13	9.09	-0.38%	-0.33%	9.62	6.87	
DI Future Jan22 (金利先物)	%	5.605	5.675	1.25%	12.82%	5.78	2.82	
3 Months US Dollar Libor	%	0.14488	0.14575	0.60%	10.94%	0.2413	0.1180	
CRB Index (国際商品指数)	Index	211.32	213.39	0.98%	3.74%	214.08	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。