

Sumitomo Mitsui Banking Corporation Brazil DAILY MARKET REPORT



Treasury Department

マーケットサマリー

昨日のドルレアルスポット相場は当局によるレアル下支えの思惑からレアル高となる展開でした。朝方は前日に中銀が従来と同規模の介入プログラム継続を発表したため、前日比レアル高の2.20台後半から始まりました。また、米国の5月耐久財受注や第1四半期GDP確定値が市場予想より悪化したこともドル売りを誘い一時2.20近辺へレアル高が進みましたが、直近のレアル高値近辺であることから利食いも入り2.20台後半へ戻しました。その後は小動きとなり、結局そのまま2.20台後半で引けています。

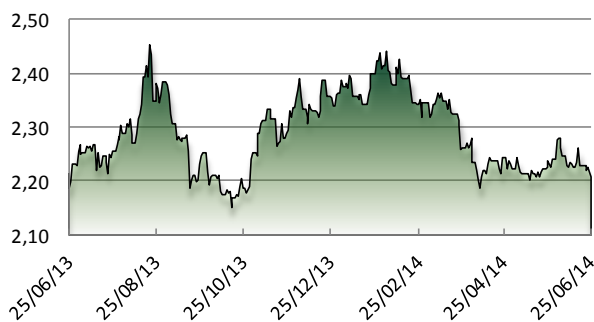
介入プログラムの詳細が発表された後の相場はレアル買い優勢となりました。先月、トンビニ中銀総裁がスワップ介入への市場からの需要が減っている旨発言し、一部では介入プログラムの規模が縮小されるとの思惑も台頭していたため、同額でのプログラム延長は市場にとって若干サプライズとなったようです。今月は来月初満期分のスワップを全額ロールオーバーする方針に中銀が切り替えたこともあり、次は来月のロールオーバーペースに注目が集まります。市場はそのような当局の意向を確かめるように直近のレアル高値である2.20よりレアル高を試しに行く可能性が高いでしょう。ただ、当局にレアル高を誘導する意図があるとも思えないため、2.20よりレアル高の水準ではロールオーバーの金額を調整して相場の変動を抑えに来ると思われるます。

マーケットデータ

Indicator	Unit	6月24日	6月25日	前日比	5月23日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	45,83	46,14	+0,31	45,86	+0,28
USD / BRL Spot	BRL	2,2250	2,2078	-0,0172	2,2233	-0,0155
USD / JPY Spot	JPY	101,97	101,87	-0,10	101,97	-0,10
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	54.281	53.426	-855	52.626	+800
CDS Brazil 5yrs (クレディットデフォルトスワップ)	bps	141,0	136,8	-4,2	153,4	-16,6
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	11,73	11,73	+0,00	11,94	-0,21
DI Future Jul15 (金利先物)	%	10,93	10,91	-0,02	11,25	-0,34
3 Months US Dollar Libor	%	0,234	0,234	+0,000	0,229	+0,005
CRB Index (国際商品指数)	Index	312,0	312,8	+0,8	308,3	+4,5

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社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

