

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中国の良好な経済指標からレアル高となる展開でした。朝方は中銀からスワップロールオーバー実施の情報が出てこなかったため、一時前日比レアル安の2.21台半ばで取引されましたが、6月の中国製造業購買担当者指数が6ヶ月ぶりの高水準を記録したことから輸出拡大の思惑が広がったため、前日比レアル高の2.20台前半へレアルは買い戻されました。その後は小動きとなり、6月の貿易収支が市場予想を若干下回る黒字となりましたが市場の反応は限定的で結局2.20台前半で引けています。

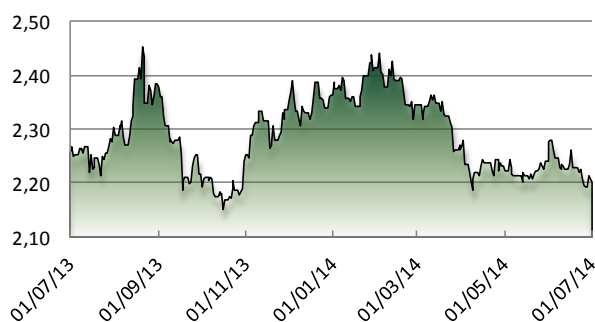
中銀は昨晚マーケット引け後に来月初満期のスワップロールオーバーを本日から始めることをアナウンスしました。金額は3.5億ドルとしており、仮にこのペースが月末まで続くと77億ドルがロールオーバーされることとなります。来月初満期のスワップ残高はおよそ94.6億ドルあるため約81%がロールオーバーされると予想され、残りの17.6億ドル程度が市場から買い戻される計算です。先月は約86%をロールオーバーして13.1億ドルを買い戻した形だったので、中銀としては若干多めの買い戻しを行うことで現行水準以上のレアル高も望まないとのメッセージを出していると思われます。但し、今月以降も延長した介入プログラム自体は1営業日あたり新規に2億ドル売却することになっていますので、今月はネットで28.6億ドルのドル売りが発生する計算となり、基本的にレアル高・レアル安双方向共に抑制する姿勢を維持しています。

マーケットデータ

Indicator	Unit	6月30日	7月1日	前日比	6月2日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	45,76	46,11	+0,35	44,97	+1,14
USD / BRL Spot	BRL	2,2143	2,2019	-0,0124	2,2767	-0,0748
USD / JPY Spot	JPY	101,33	101,53	+0,20	102,38	-0,85
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	53.168	53.171	+3	51.606	+1.565
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	144,2	142,8	-1,4	145,7	-2,9
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	11,73	11,73	+0,00	11,87	-0,14
DI Future Oct15 (金利先物)	%	11,05	10,98	-0,07	11,32	-0,33
3 Months US Dollar Libor	%	0,231	0,232	+0,001	0,227	+0,005
CRB Index (国際商品指数)	Index	308,2	307,4	-0,8	305,4	+2,0

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

