

Sumitomo Mitsui Banking Corporation Brazil DAILY MARKET REPORT



Treasury Department

マーケットサマリー

昨日は、「今週公表予定の各世論調査でシルバ氏のリード幅が縮小する」との一部観測を手掛かりに、これまでの「リアル買い・株買い」の巻き戻しが広範囲に及んだ。ドルレアルスポット相場は2.24台前半から始まると、ジリジリと上昇し、一時2.27台前半まで上値を伸ばした。ボベスパ株式指数も午後に入ると急速に下げ足を早め、前日比2.5%まで急落。金利低下が進んでいた先物金利市場では、ほぼ全ての限月でその低下幅を取り戻す展開となった。

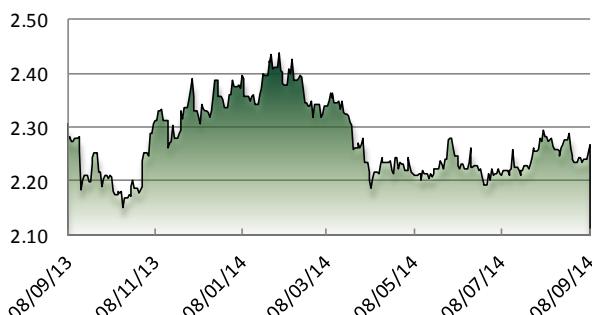
先週後半に公表されたIbope、Datafolhaの各世論調査では、シルバ氏優勢ながらルセフ大統領との差が僅かながらに縮まる結果となった。今週は、本日のCNT/MDAを皮切りに、再びIbope、Datafolha両社の世論調査が予定されているが、ルセフ大統領のさらなる巻き返しを警戒した動きがマーケット全体を席巻し、為替・株・金利の全てにおいてポジション圧縮が加速。特に、ボベスパ株式指数は、中銀公表の週次サーベイにおいて、年末成長率見通しが15週連続となる0.48%まで低下したことも影響し、調整幅が大きくなつたと見られる。予想を下回る内容となつた米8月雇用統計をマーケットは無難に消化しており、再びドル買い・米金利上昇の動きが強まつて。ドルレアルは米金融政策の動向と世論調査の結果に左右される展開が今後も続くと思われるが、中銀は見送つて10月1日償還分の通貨スワップロールオーバーを昨日開始しており、中銀の介入姿勢の変化も併せて注目する必要がある。

マーケットデータ

Indicator	Unit	9月5日	9月8日	前日比	8月8日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	46.88	46.75	-0.13	44.67	+2.08
USD / BRL Spot	BRL	2.2418	2.2675	+0.0257	2.2833	-0.0158
USD / JPY Spot	JPY	105.09	106.03	+0.94	102.04	+3.99
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	60,682	59,193	-1,489	55,573	+3,620
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	125.7	130.3	+4.6	167.0	-36.7
Brazil 10yrs Gov. Bond	%	11.15	11.40	+0.25	12.01	-0.61
DI Future Oct15 (金利先物)	%	11.28	11.31	+0.03	11.30	+0.01
3 Months US Dollar Libor	%	0.232	0.232	+0.000	0.235	-0.003
CRB Index (国際商品指数)	Index	288.0	286.8	-1.2	292.4	-5.6

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



リアル円スポットチャート

