

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、序盤は方向感なく推移していたものの、引けにかけて急速にレアル売りが進行し、終値ベースで2.93台を記録した。マーケットでは中銀による為替介入プログラムが現行期限である3月31日で打ち切られるとの観測が強まっており、レアルの重石になっていると見られる。中銀は新規にドル売りレアル買いの通貨スワップを行うと同時に、過去に実施した取引のロールオーバーを行っているが、過去分の取引についてはこれまで全額がロールオーバーされてきた。しかし、2日に実施された4月満期のロール額は3.5億ドルと、2月の6億ドルから大幅に減少しており、このペースが満期まで継続されると仮定すると80%のみがロールオーバーされる計算となる(残存部分は償還する必要があり、ドル買いレアル売り圧力となる)。レアル相場が10年ぶりの水準を記録する中でロールオーバー額を縮小させたことは「中銀がレアル安を容認した」とも受け取れるため、今後レアル安が一段と進行する可能性も想定される。

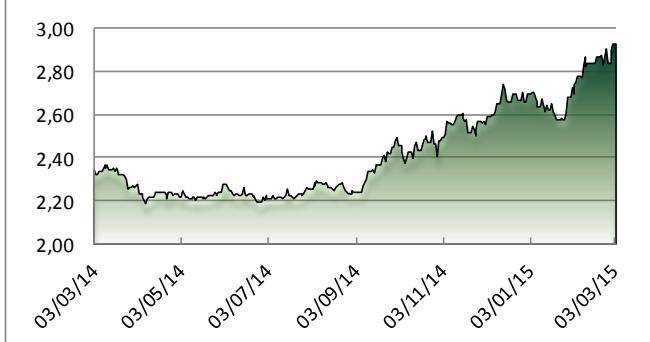
ペトロプラスは2日、債務圧縮と資金確保に向けて2015-16年に137億ドル相当の資産を売却する意向を表明。これを受けて、同社株は前日比2.1%高となり、ボベスパ株式指数も全体として底堅い動きを示した。但し、ラバ・ジャッタ作戦(汚職関連捜査)がブラジル国内に与える影響が不透明であることから、依然として楽観的なシナリオは描きにくい。今後ボベスパ指数が再び軟調な展開となれば、レアル売りがさらに進展する恐れがあるため、注意が必要である。

マーケットデータ

Indicator	Unit	3月2日	3月3日	前日比	2月3日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	41,50	40,84	-0,66	43,62	-2,78
USD / BRL Spot	BRL	2,8954	2,9316	+0,0362	2,6951	+0,2365
USD / JPY Spot	JPY	120,13	119,73	-0,40	117,57	+2,16
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	51.021	51.304	+283	48.964	+2.340
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	240,9	237,2	-3,7	224,7	+12,5
Brazil 10yrs Gov. Bond	%	12,54	12,59	+0,05	12,09	+0,50
DI Future Apr16 (金利先物)	%	13,13	13,12	-0,01	12,77	+0,35
3 Months US Dollar Libor	%	0,261	0,261	+0,000	0,255	+0,006
CRB Index (国際商品指数)	Index	222,0	222,0	+0,0	227,4	-5,4

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

