

Sumitomo Mitsui Banking Corporation Brazil DAILY MARKET REPORT



Treasury Department

マーケットサマリー

三連休明け月曜日のドルレアルスポット相場は、先週からのドル反転の流れを引き継ぎ対レアルで大きくドルが上昇する展開でした。先週のFOMC議事録で米利上げ期待が再燃した後、それまでのドル安傾向が反転する地合いのなかで先週末中銀から発表されたスワップ介入に関する今月のロールオーバー額は市場の予想に反して少額であることが判明したため、中銀がドル売りレアル買い介入に消極的であるとの市場の思惑を呼び、朝方からドル買いレアル売りが優勢となって3.06台での取引となりました。加えて中銀サーベイで公表された今年の成長率予想が先週の1.10%減から1.18%減へと更に減少幅を拡大させたこともレアル売りを誘い、一時3.08台へレアル安が進みました。終日レアル売りの地合いは続き、結局3.08台のまま引けています。

新規のドル売りレアル買い介入プログラムを停止した中銀は、残高として残っているドル売りレアル買いポジションのうち満期が到来するものを全額ロールオーバーしていましたが、今月からは全額ではなくその一部のみをロールオーバーし、残りはドル買いレアル売りを行ってポジションを縮小させる模様です。中銀は明言を避けているもののこれ以上のレアル高は望まず寧ろレアル安に戻っても構わないことを暗示していると思われますので、市場は再びレアル売り圧力に晒されやすくなるでしょう。

マーケットデータ

Indicator	Unit	4月30日	5月4日	前日比	4月2日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	39,60	38,94	-0,66	38,31	+0,63
USD / BRL Spot	BRL	3,0145	3,0865	+0,0720	3,1229	-0,0364
USD / JPY Spot	JPY	119,38	120,13	+0,75	119,72	+0,41
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	56.229	57.354	+1.125	53.123	+4.231
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	234,3	241,4	+7,1	265,4	-24,0
Brazil 10yrs Gov. Bond	%	12,80	12,89	+0,09	12,83	+0,06
DI Future Jul16 (金利先物)	%	13,67	13,69	+0,02	13,36	+0,33
3 Months US Dollar Libor	%	0,279	0,280	+0,001	0,274	+0,006
CRB Index (国際商品指数)	Index	229,5	227,8	-1,7	216,1	+11,7

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

