

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、ブラジル中銀がリバース通貨スワップを介したドル買い介入の規模を、1日当たり1万枚から1万5千枚(先物での7.5億ドルのドル買いに相当)に増加したことを受けて取引開始直後からレアル売りが優勢となり、一時3.15台半ばまでレアル安が進行した。介入規模の拡大は、7月1日にリバース通貨スワップを開始して以降初めて。Goldfajn中銀総裁は従来より、「為替相場は自由変動であるべき」との考えを示していたが、突如介入規模を拡大したため、市場参加者は「既存スワップポジションの解消以外に狙いがあるのではないか」との考えを強めている(特定の水準以上にレアル高が進行することを警戒している可能性がある)。介入増額が数日限りに留まるのか、継続されるのか、中銀の今後の方針に注目が集まる。なお、現在のスワップポジション残高は約480億ドル前後であるため、仮に1日当たり7.5億ドルの介入が続いた場合、約64営業日でポジションが解消されることになる。

Globo紙が報じたところによると、ブラジル上院議長のCalheiros氏は、ルセフ大統領の弾劾審議開始時期について、当初見通しの25日より早い23日に実施する可能性があると発言した。最終的には、弾劾審議の議長を務める最高裁長官であるRicardo Lewandowski氏が決定を行う。

マーケットデータ

Indicator		Unit	8月10日	8月11日	前日比	7月11日	1ヶ月前比
レアル	対ドル	BRL	3,1274	3,1444	+0,0170	3,3094	-0,1650
	対円	JPY	32,36	32,42	+0,06	31,06	+1,36
	対ユーロ	BRL	3,4984	3,5019	+0,0035	3,6590	-0,1571
円	対ドル	JPY	101,29	101,96	+0,6700	102,80	-0,8400
	対ユーロ	JPY	113,21	113,55	+0,34	113,68	-0,13
Bovespa (ブラジル株価指数)		Index	56.920	58.300	+1.380	53.960	+4.340
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)		bps	262,1	258,3	-3,8	305,8	-47,5
Brazil 10yrs Gov. Bond		%	11,79	11,84	+0,05	12,01	-0,17
DI Future Apr17 (金利先物)		%	13,61	13,62	+0,01	13,54	+0,08
3 Months US Dollar Libor		%	0,818	0,818	+0,000	0,669	+0,149
CRB Index (国際商品指数)		Index	179,5	182,0	+2,5	186,7	-4,7

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。

