

Banco Sumitomo Mitsui Brasileiro S.A. 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NY祝日で薄商いのなか上下に振れたものの先週末比あまり変わらない展開でした。朝方は、週次サーベイで今年末の成長率見通しが引き上げられたことなどにより先週末比レアル高の2.17台前半から2.16台後半で取引されました。しかし、来月初に満期を迎えるスワップの一部しかロールオーバーしないとの観測記事が出たため急速にレアル売りとなり、一時2.19近辺での取引となりました。その後は米財政協議進展への期待から株式相場が堅調だったためレアル買戻しも入り結局2.17台後半で引けています。

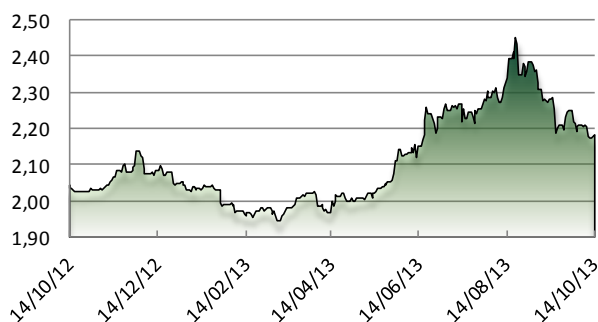
トビニ中銀総裁が来年の介入プログラム継続の可能性を示唆するなか、市場では来月初満期のスワップが一部ロールオーバーされないのではないかと、思惑が広がっています。観測記事は匿名の政府筋が、「来月初のロールオーバーは市場環境次第」と発言したとされており、当局が市場の反応を確かめようとしている印象を受けます。大幅なレアル安抑制という当初の目的を介入プログラムによって達成した当局はここから先の大幅なレアル高も望んでおらず市場へのけん制を模索しているようです。

マーケットデータ

Indicator	Unit	10月11日	10月14日	前日比	9月13日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	45,31	45,16	-0,15	43,57	+1,59
USD / BRL Spot	BRL	2,1761	2,1826	+0,0065	2,2802	-0,0976
USD / JPY Spot	JPY	98,58	98,57	-0,01	99,38	-0,81
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	53.150	54.171	+1.021	53.798	+373
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	148,0	147,7	-0,3	173,0	-25,3
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	11,45	11,53	+0,08	11,89	-0,36
DI Future Apr14 (金利先物)	%	9,88	9,87	-0,01	9,67	+0,20
3 Months US Dollar Libor	%	0,244	0,246	+0,002	0,254	-0,008
CRB Index (国際商品指数)	Index	286,6	287,5	+0,9	291,0	-3,5

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社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

