

## 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内外の要因からドル安レアル高となる展開でした。朝方は、前日の取引時間中に発表していなかった介入プログラムのスワップ介入実施をマーケット引け後に中銀がアナウンスしたため、前日比レアル高の2.16台後半から始まりました。また、COPOM議事録で利上げ継続が示唆されたこともありレアル買い優勢な地合いは続き、2.15台後半での取引となりました。その後は2.16を挟んでもみ合いとなったものの米政府閉鎖の影響から米緩和策が当面続けられるとの観測が台頭したため再びドル売り地合いとなり、結局2.15台前半で引けています。

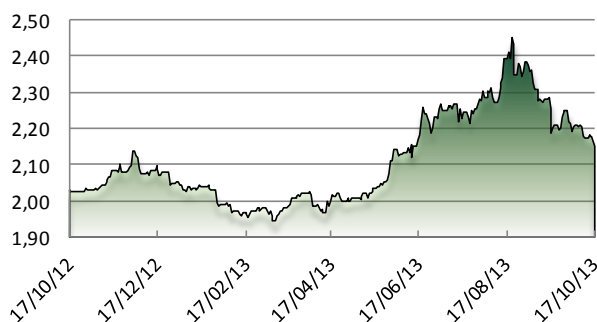
市場では米政府閉鎖の影響から経済の先行き見通しが不透明になったことや債務上限引き上げは問題が数ヶ月先送りになっただけで再燃する可能性が高いこと等の要因から米緩和策が当面続けられるとの観測が台頭しています。これによりドル売りと共に高金利通貨を選好するキャリートレードが優勢になっており、レアルも最も利上げされた通貨として選好対象になっているようです。中銀がインフレ抑制を重視するなか介入プログラムを当初予定通り年末まで続けると強調していることもレアル相場のボラティリティ抑制につながりキャリートレードへのインセンティブを高めます。市場は当局のレアル高許容度を睨みながらもキャリートレードの下地を作りつつあるようです。

## マーケットデータ

Indicator	Unit	10月16日	10月17日	前日比	9月17日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	45,29	45,49	+0,20	43,92	+1,57
USD / BRL Spot	BRL	2,1804	2,1523	-0,0281	2,2561	-0,1038
USD / JPY Spot	JPY	98,77	97,91	-0,86	99,13	-1,22
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	55.973	55.358	-615	54.271	+1.087
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	145,6	149,2	+3,6	164,5	-15,3
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	11,54	11,50	-0,04	11,84	-0,34
DI Future Apr14 (金利先物)	%	9,88	9,93	+0,05	9,65	+0,28
3 Months US Dollar Libor	%	0,246	0,242	-0,004	0,252	-0,010
CRB Index (国際商品指数)	Index	287,6	286,4	-1,2	286,7	-0,3

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

