

Banco Sumitomo Mitsui Brasileiro S.A. DAILY MARKET REPORT



Treasury Department

マーケットサマリー

先週金曜日のドルレアルスポット相場は、値ごろ感から実需のドル買いが噂されドル買い戻しとなる展開でした。朝方は前日からのドル売り地合いにより一時2.14台後半で取引される局面もありましたが、10月前半までのIPCA-15が市場予想を上回ったことからインフレ懸念が台頭したためレアルは2.16台へ売られました。その後、2.16台前半でもみ合いとなりましたが、一部輸入筋のドル買いが噂されてドルは続伸し2.17台後半での取引となりました。引けにかけては週末を控えてポジション調整も入り、結局2.17近辺で引けています。

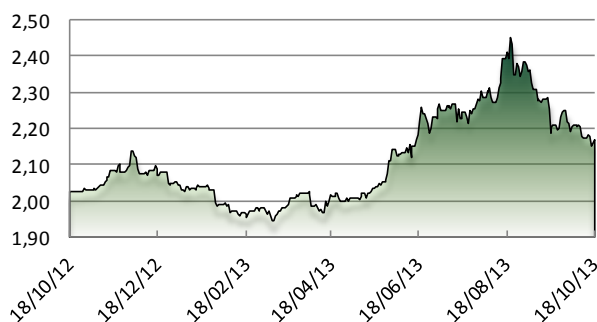
今朝発表された週次サーベイでは、今年末のインフレ見通しは5.81%から5.83%へ引き上げられ、同成長率見通しは2.48%から2.50%へ引き上げられました。政策金利見通しは今年末時点で10.00%、来年末時点で10.25%へそれぞれ9.75%から引き上げられたことにより来年末のインフレ見通しは5.95%から5.94%へ若干引き下げられました。COPOM議事録でのタカ派姿勢維持を受けて政策金利見通しが引き上げられたようですが、インフレ見通しは大きく改善したわけではなく未だに高止まりしている印象です。

マーケットデータ

Indicator	Unit	10月17日	10月18日	前日比	9月18日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	45,49	45,03	-0,46	44,81	+0,22
USD / BRL Spot	BRL	2,1523	2,1700	+0,0177	2,1860	-0,0160
USD / JPY Spot	JPY	97,91	97,72	-0,19	97,94	-0,22
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	55.358	55.378	+20	55.703	-325
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	149,2	152,4	+3,2	145,0	+7,4
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	11,50	11,65	+0,15	11,36	+0,29
DI Future Apr14 (金利先物)	%	9,93	9,94	+0,01	9,52	+0,42
3 Months US Dollar Libor	%	0,242	0,241	-0,001	0,252	-0,011
CRB Index (国際商品指数)	Index	286,4	286,9	+0,5	289,5	-2,6

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

