

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スワップ介入のロールオーバーへの思惑からレアル安となる展開でした。朝方はリブラ油田の権益入札に伴ってレアル買いが出るとの思惑から先週末比レアル高の2.16台後半で始まりましたが、来月初に満期を迎えるおよそ89億ドルのスワップのロールオーバーに関して中銀がマーケットの需要を調査していると報道されたことから、一部ロールオーバーが実施されないと思惑が高まり、2.17台後半へレアルは売られました。その後、2.18近辺で取引される局面もありましたが、結局2.17台半ばで引けています。

来月初満期のスワップについて中銀は昨夜マーケット引け後におよそ10億ドルのロールオーバーを本日行うと発表しました。但し、月末にかけて全額のロールオーバーを行うかについての言及は今のところありません。市場の反応を見ながら金額を調整していくのでしょうか。このスワップに関しては、中銀がドルショートポジションを保有していることになりますから、そのポジションをロールオーバーしない場合は中銀がドルを買い戻すことになりドル買い介入と同じ効果が生まれます。介入プログラムの継続と併せて市場は中銀の動向に神経質な展開となりそうです。

マーケットデータ

| Indicator | Unit | 10月18日 | 10月21日 | 前日比 | 9月21日 | 1ヶ月前比 |
|------------------------------------|-------|--------|--------|---------|--------|---------|
| BRL / JPY Spot | JPY | 45,03 | 45,14 | +0,11 | 44,96 | +0,18 |
| USD / BRL Spot | BRL | 2,1700 | 2,1751 | +0,0051 | 2,2105 | -0,0354 |
| USD / JPY Spot | JPY | 97,72 | 98,19 | +0,47 | 99,36 | -1,17 |
| Bovespa (ブラジル株価指数) | Index | 55.378 | 56.077 | +699 | 54.110 | +1.967 |
| CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ) | bps | 152,4 | 160,3 | +7,9 | 160,4 | -0,1 |
| Brazil 5yrs Gov. Bond | % | 11,65 | 11,76 | +0,11 | 11,27 | +0,49 |
| DI Future Apr14 (金利先物) | % | 9,94 | 9,96 | +0,02 | 9,54 | +0,42 |
| 3 Months US Dollar Libor | % | 0,241 | 0,239 | -0,002 | 0,250 | -0,011 |
| CRB Index (国際商品指数) | Index | 286,9 | 285,3 | -1,6 | 287,4 | -2,1 |

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

