

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介入縮小観測からレアル安となる展開でした。朝方は、9月の失業率が市場予想を上回ったことやスワップロールオーバーが10億ドルと小額だったことなどから前日比レアル安の2.19台後半から始まりました。その後も中銀が来月初満期のスワップを全額ロールオーバーしないとの観測からレアルは売られ一時2.10台後半での取引となりましたが、米新規失業保険申請件数が予想を上回るなど米経済への懸念から2.19台後半へ切り返す不安定な展開でした。しかし、介入縮小への市場の懸念は強く午後には再度レアル売りとなり、結局2.20台前半で引けています。

市場では米緩和策縮小先送り観測から全般的にドル軟調な地合いですが、ドルレアル相場は介入縮小への思惑から逆にレアル軟調な展開が続いています。来月初満期のスワップおよそ89億ドルのうち、今週ここまで30億ドル分がロールオーバーされました。更に中銀は来週28, 29, 30日にもロールオーバーを行うことを昨夜アナウンスしています。金額は明示されませんでしたが、これまでと同じ10億ドルずつ計30億ドルのロールオーバーが行われる可能性が高いと思われます。そうなればおよそ3分の1はロールオーバーされないこととなり、中銀がここから過度なレアル高を望んでいないことが示されるでしょう。

マーケットデータ

Indicator	Unit	10月23日	10月24日	前日比	9月24日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	44,46	44,15	-0,31	44,86	-0,71
USD / BRL Spot	BRL	2,1905	2,2033	+0,0128	2,2010	+0,0023
USD / JPY Spot	JPY	97,38	97,28	-0,10	98,75	-1,47
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	55.440	54.877	-563	54.431	+446
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	160,1	163,2	+3,1	162,8	+0,4
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	11,50	11,55	+0,05	11,28	+0,27
DI Future Apr14 (金利先物)	%	9,93	9,94	+0,01	9,49	+0,45
3 Months US Dollar Libor	%	0,238	0,238	+0,000	0,250	-0,012
CRB Index (国際商品指数)	Index	281,7	281,7	+0,0	285,2	-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

