

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材料難から総じて小動きの展開でした。朝方は前日比若干レアル安の2.18台前半で始まりましたが、米小売売上高が予想を下回ったためドル売り優勢となり一時2.17台半ばでの取引となりました。しかし、FOMCの声明を控えていることや来月初満期のスワップが全額分ロールオーバーされない見通しになってきたことなどからレアル買いも続かず、2.18台へ戻されました。その後は小動きとなり、結局2.18台半ばで引けています。

目前の注目材料となっていた来月初満期のスワップロールオーバーは、本日実施分の金額が10億ドルと昨夜アナウンスされ、合計で60億ドルがロールオーバーされることとなりました。89億ドルの残高に対して3分の1はロールオーバーせずに中銀がドルを買い戻す形となりますので、現状のドルレアル相場水準からの過度なレアル高も抑えていく意図を市場に示唆したものと思われます。但し、介入プログラムは当初計画通り続けられていますから主な目的がレアル安抑制であることは変わっていません。12月初めにもスワップ残高がおよそ101億ドルあるため、今回と同じような調整を入れながら中銀は市場をコントロールしていくつもりでしょう。

■ マーケットデータ

Indicator	Unit	10月28日	10月29日	前日比	9月27日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	44,82	44,93	+0,11	43,62	+1,31
USD / BRL Spot	BRL	2,1789	2,1851	+0,0062	2,2523	-0,0672
USD / JPY Spot	JPY	97,68	98,19	+0,51	98,24	-0,05
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	55.073	54.539	-534	53.739	+800
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	164,0	165,3	+1,3	176,6	-11,3
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	11,46	11,48	+0,02	11,58	-0,10
DI Future Apr14 (金利先物)	%	9,95	9,96	+0,01	9,55	+0,41
3 Months US Dollar Libor	%	0,236	0,237	+0,001	0,248	-0,011
CRB Index (国際商品指数)	Index	281,9	280,6	-1,3	287,0	-6,4

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

