

## 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は格下げや米緩和策縮小への懸念からレアル売り優勢となる展開でした。朝方は中銀が来月初満期のスワップ介入のロールオーバーを始めるアナウンスしたことから先週末比若干レアル高の2.30台後半で始まりましたが、週次サーベイの見通しが悪化したことからレアル買いは続かず2.31台へ切り返しました。その後も先週発表された格下げの可能性や予想を上回った米雇用統計などの余韻からレアルは売り優勢となり、2.33台へレアル続落となりました。一時2.34台前半までレアル安は進みましたが、先週の貿易統計が予想を上回る黒字となつたため2.33近辺へレアルが買い戻された後はもみ合いとなり、結局2.33台前半で引けています。

中銀は来月初満期のスワップロールオーバーを本日から始めるとアナウンスしました。金額は10億ドル相当となっており、このペースで毎日続ければ満期までにおよそ100億ドル全額がロールオーバーされることになりますが、最近のレアル安を勘案すれば当然の措置と言えるでしょう。しかし、ロールオーバー自体はレアル安に歯止めをかけられるものではなく、実際に昨日はNY祝日で主要通貨の動きが鈍かつたにもかからわずレアルは売られました。市場におけるレアルへの懸念が根強いことを表しており、今後もレアル売り圧力は燻り続けるでしょう。

## マーケットデータ

Indicator	Unit	11月8日	11月11日	前日比	10月11日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	42,83	42,52	-0,31	45,31	-2,79
USD / BRL Spot	BRL	2,3133	2,3318	+0,0185	2,1761	+0,1557
USD / JPY Spot	JPY	99,05	99,16	+0,11	98,58	+0,58
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	52.249	52.624	+375	53.150	-526
CDS Brazil 5yrs (クレジット・フルトスワップ)	bps	204,5	204,9	+0,4	148,0	+56,9
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	12,31	12,44	+0,13	11,45	+0,99
DI Future Apr14 (金利先物)	%	10,12	10,14	+0,02	9,88	+0,26
3 Months US Dollar Libor	%	0,239	0,239	+0,000	0,244	-0,005
CRB Index (国際商品指数)	Index	274,4	274,8	+0,4	286,6	-11,8

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

