

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警戒感から神経質な展開となりました。朝方は市場で燦る米緩和策縮小観測や格下げ懸念の流れを引き継いで前日比レアル安の2.34台前半から始まりました。一時的に2.34台後半へレアルは売られましたが、中銀がスワップロールオーバーを始めたこともあって介入警戒感が高まり、2.33近辺へレアルは買い戻されました。その後も、レアルへの懸念と介入警戒から神経質な動きは続き、2.32台半ばから2.34台前半のレンジで荒い値動きとなりましたが、結局2.33台前半で引けています。

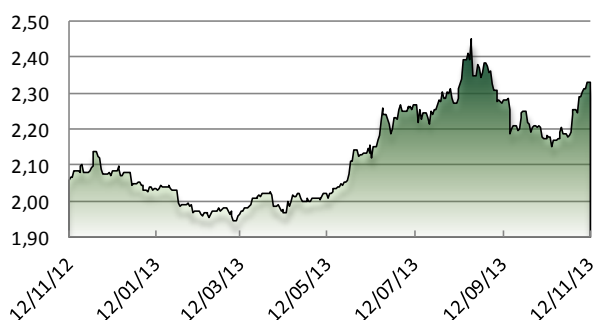
中銀は本日も10億ドル規模のスワップロールオーバーを行うことを昨夜アナウンスしました。1日当たり10億ドルのペースを続けて満期までに全額ロールオーバーするものと思われます。市場は急速にレアル安が進んできたこともあり介入警戒で神経質な動きになっているようですが、先月と違って全額ロールオーバーするとしても新たなドル売りが発生するわけではないのでアナウンスメント効果以上のものは望めません。8月に導入された介入プログラムは現在も続けられていますが、市場は当局がそれ以上の動きを起こすのか試みにいこうとするでしょう。

マーケットデータ

Indicator	Unit	11月11日	11月12日	前日比	10月11日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	42,52	42,73	+0,21	45,31	-2,58
USD / BRL Spot	BRL	2,3318	2,3321	+0,0003	2,1761	+0,1560
USD / JPY Spot	JPY	99,16	99,64	+0,48	98,58	+1,06
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	52.624	51.804	-820	53.150	-1.346
CDS Brazil 5yrs (クレディットデフォルトスワップ)	bps	204,9	206,8	+1,9	148,0	+58,8
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	12,44	12,33	-0,11	11,45	+0,88
DI Future Apr14 (金利先物)	%	10,14	10,11	-0,03	9,88	+0,23
3 Months US Dollar Libor	%	0,239	0,239	+0,000	0,244	-0,005
CRB Index (国際商品指数)	Index	274,8	273,4	-1,4	286,6	-13,2

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

