

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テーパリング観測による資金流出懸念からレアルが売られる展開でした。朝方は米議会が財政協議で暫定合意したことによりテーパリングへの障害の一つがなくなったとの観測からドル買い優勢となり、前日比レアル安の2.31台前半から始まりました。その後もドル高レアル安基調となり2.32台で取引された後、先週分の為替フロー統計が26.5億ドルの資金流出となったことで更にレアルは売られ2.34近辺へレアル安となりました。そのままレアル安地合いは続き、結局2.34台前半で引けています。

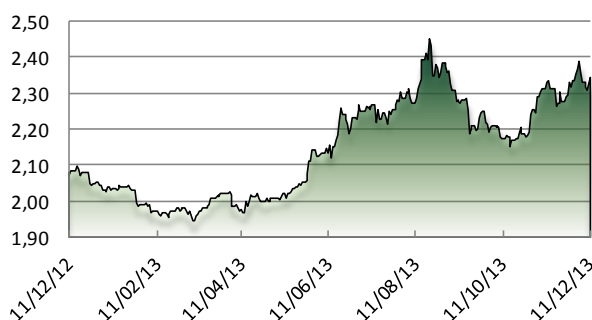
昨日発表された先週分の為替フロー統計は26.5億ドルの資金流出となり、11月累計で記録した25.4億ドルの資金流入を上回りました。今年の6月以来月間ベースで続いていた資金流出が11月に資金流入へと転じたばかりでしたが、その流入分はわずか一週間分の流出で相殺された形です。テーパリング観測がにわかに高まるなか資金流出への懸念は続いている状態です。そのため中銀はそういった懸念を見越して来週のFOMC後に介入プログラム延長の詳細を発表するつもりなのでしょう。トンビニ総裁がテーパリングに対する備えはできていると述べていたのは、介入で為替相場のボラティリティを抑える自信があることの表れと思われます。

マーケットデータ

Indicator	Unit	12月10日	12月11日	前日比	11月11日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	44,59	43,73	-0,86	42,52	+1,21
USD / BRL Spot	BRL	2,3067	2,3423	+0,0356	2,3318	+0,0105
USD / JPY Spot	JPY	102,85	102,42	-0,43	99,16	+3,26
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	50.993	50.068	-925	52.624	-2.556
CDS Brazil 5yrs (クレディットデフォルトスワップ)	bps	184,5	186,2	+1,7	204,9	-18,7
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	12,53	12,56	+0,03	12,44	+0,12
DI Future Jul14 (金利先物)	%	10,26	10,22	-0,04	10,55	-0,33
3 Months US Dollar Libor	%	0,242	0,244	+0,002	0,239	+0,005
CRB Index (国際商品指数)	Index	280,8	281,0	+0,2	274,8	+6,2

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

