

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、中国の2013年GDP成長率が7.7%と堅調であったことが発表されたことを受け先週金曜日の終値2.3423から強含んでスタートし2.338台をつけました。その後ブラジル企業による海外での起債などを受けレアルはレアルは堅調に推移しましたが、終盤は売りが入り最終的には先週金曜日より若干のレアル安となる2.343台で引けています。

昨日ブラジル中銀は日々の200百万ドルの通貨スワップによる介入に加え、2月期日の通貨スワップの内12億ドルをロールオーバーしました。2月期日のスワップは合計110億ドルありますが、中銀は1月に続きこの全てをロールオーバーする姿勢を見せたものと思われレアルのサポート材料になっています。

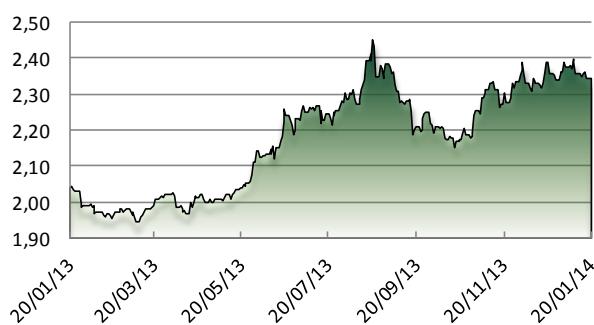
また、ジウマ大統領は昨日ラジオのインタビューで「インフレーションを目標値(4.5%)まで下げるための努力は続けていくし、近い将来そのレベルまで引き下げる自信がある」とコメントしインフレ引き下げへの強い姿勢を示しました。但し、中銀発表のエコノミスト・サーベイでは2015年のインフレ率予測が先週より10ポイント引き上げられ5.60%となる(2014年は6.01%)など市場の不信感は尚燻っており、レアルはボラタイルな動きを続けるでしょう。

マーケットデータ

Indicator	Unit	1月17日	1月20日	前日比	12月20日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	44,53	44,46	-0,07	43,61	+0,85
USD / BRL Spot	BRL	2,3425	2,3433	+0,0008	2,3874	-0,0441
USD / JPY Spot	JPY	104,32	104,18	-0,14	104,10	+0,08
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	49.182	48.708	-474	51.186	-2.478
CDS Brazil 5yrs (クレジット・フルトスワップ)	bps	196,5	194,5	-2,0	186,3	+8,2
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	12,68	12,81	+0,13	12,84	-0,03
DI Future Oct14 (金利先物)	%	10,81	10,89	+0,08	10,46	+0,43
3 Months US Dollar Libor	%	0,237	0,237	+0,000	0,248	-0,011
CRB Index (国際商品指数)	Index	278,4	278,4	+0,0	283,1	-4,7

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

