

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上下動あつたものの前日とほぼ同じ水準に落ち着く展開となりました。朝方は前日比ほぼ変わらない水準の2.40台半ばで始まった後、米ADP雇用統計が市場予想を下回ったことからリスク回避のレアル売りとなり2.41台後半へレアル安が進みました。しかし、午後になると中銀が来月初満期のスワップ介入をロールオーバーするとの思惑が広がったため2.39台前半へレアル買戻しとなりました。その後は調整から2.40台での取引となり、結局2.40台前半で引けています。マーケット引け後には中銀が翌日から来月初満期のスワップロールオーバーを開始するとアナウンスしています。

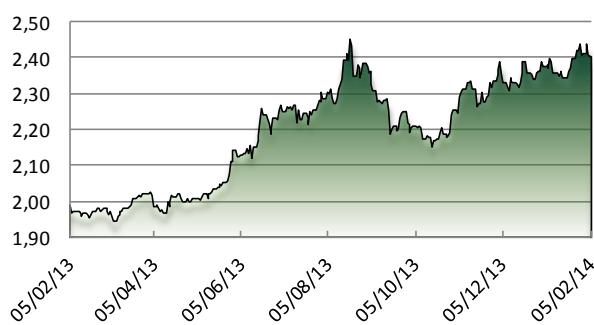
ここ数日のレアル相場は2.45近辺の安値をつけてから調整地合いとなっています。一部米経済指標の悪化後に雇用統計を控えていることや介入警戒感も微妙に作用していると思われますが、テーパリングについては月100億ドルの減額ペースがコンセンサスになっており相当のショックがない限り、このペースを緩めることはないでしょう。また、介入についてもロールオーバー開始のタイミングを早めていますが、ロールオーバー自体は相場にニュートラルであり現状のレアル安傾向を勘案すれば最低限のことをしているだけです。新興国通貨売りからのレアル売りも若干スピードが速かったため速度調整をしているだけであって今後いつレアル売りが再開してもおかしくない状態は続いています。

マーケットデータ

Indicator	Unit	2月4日	2月5日	前日比	1月3日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	42,26	42,23	-0,03	44,12	-1,89
USD / BRL Spot	BRL	2,4055	2,4024	-0,0031	2,3765	+0,0259
USD / JPY Spot	JPY	101,64	101,45	-0,19	104,86	-3,41
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	46.964	46.624	-340	50.981	-4.357
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	198,8	192,7	-6,1	189,0	+3,7
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	13,14	13,02	-0,12	12,86	+0,16
DI Future Jan15 (金利先物)	%	11,57	11,46	-0,11	10,54	+0,92
3 Months US Dollar Libor	%	0,236	0,236	+0,000	0,240	-0,004
CRB Index (国際商品指数)	Index	286,4	287,1	+0,7	276,5	+10,6

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

