

Sumitomo Mitsui Banking Corporation Brazil 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、次の節目として注目される2.5乗せを試す展開となった。公表された8月鉱工業生産は、前月比0.7%増と予想を上回る内容となったものの（前年比では5.4%減）、足許で続くレアル売りを反転させるほどの材料とは見なされなかった。一方、ボベスパ株式指数は4営業日ぶりに反発。週間での下げ幅が拡大していたこともあり、安値での買いが優勢となった。

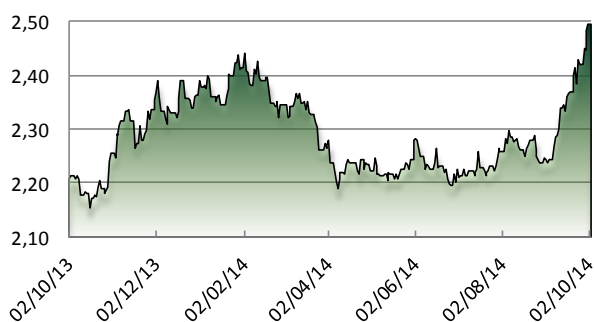
今週末には大統領選第1回投票が実施される。昨日公表されたDatafolha, Ibopeの両世論調査では、ルセフ大統領、シルバ氏、ネベス氏の予想得票率はそれぞれ、40対24対21、40対24対19と、いずれもルセフ大統領勝利との見通しが示された。大方の見方通り、ルセフ大統領とシルバ氏が決戦投票に進出するという予想に変更はないものの、一部では第1回投票におけるシルバ氏とネベス氏の得票率が僅差となっていることから、ルセフ大統領が過半数を獲得し再選を果たすとのシナリオも指摘されている。仮にこのシナリオが実現した場合、週明けのドルレアルスポット相場はレアル安水準で大きく反応することが想定されるため警戒したい。なお、本日は米国サイドで9月雇用統計の公表が予定されている。週末にかけてリスク回避の動きが強まったことで、グローバルに株の調整が進行。予想を下回る数字となれば、大統領選を控えていることもあり、ポジション調整からレアル売りが後退する可能性も有り得る。

マーケットデータ

| Indicator | Unit | 10月1日 | 10月2日 | 前日比 | 9月2日 | 1ヶ月前比 |
|---------------------------------|-------|--------|--------|---------|--------|---------|
| BRL / JPY Spot | JPY | 43,86 | 43,47 | -0,39 | 46,85 | -3,38 |
| USD / BRL Spot | BRL | 2,4811 | 2,4949 | +0,0138 | 2,2436 | +0,2513 |
| USD / JPY Spot | JPY | 108,89 | 108,42 | -0,47 | 105,09 | +3,33 |
| Bovespa（ブラジル株価指数） | Index | 52.858 | 53.519 | +661 | 61.896 | -8.377 |
| CDS Brazil 5yrs（クレジットデフォルトスワップ） | bps | 176,1 | 176,1 | +0,0 | 125,8 | +50,3 |
| Brazil 10yrs Gov. Bond | % | 12,50 | 12,42 | -0,08 | 10,93 | +1,49 |
| DI Future Jan16（金利先物） | % | 12,00 | 12,03 | +0,03 | 11,27 | +0,76 |
| 3 Months US Dollar Libor | % | 0,233 | 0,233 | +0,000 | 0,233 | +0,000 |
| CRB Index（国際商品指数） | Index | 277,9 | 277,3 | -0,6 | 289,3 | -12,0 |

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社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

