

Sumitomo Mitsui Banking Corporation Brazil DAILY MARKET REPORT



Treasury Department

マーケットサマリー

米9月小売売上高の大幅な下振れを受け(前月比▲0.3%、コア▲0.2%)、マーケットはパニックに近い反応を示した。米ダウ平均株価の下げ幅は一時450ドルまで拡大、米10年債利回りも2%割れまで急低下。その後、「イエレンFRB議長が景気拡大に自信表明」との報道もあり、やや落ち着きを取り戻したものの、エボラ出血熱の拡大懸念も心理的圧迫要因となり、グローバルにリスク回避の動きが加速した。これまで「株価上昇・金利上昇・ドル高」というシナリオを想定していた市場参加者は、急速にポジションの巻き戻しを余儀なくされている。このような中、ドルレアススポット相場も2.46台前半までレアル売りが進行。ボベスパ株式指数も前日比3.2%安となり、週初の上昇分の大半を打ち消した。ブラジル8月小売売上高は前月比1.1%増、9月就業者数は12万3785人(9月としては2001年以来の低い伸び)となった。

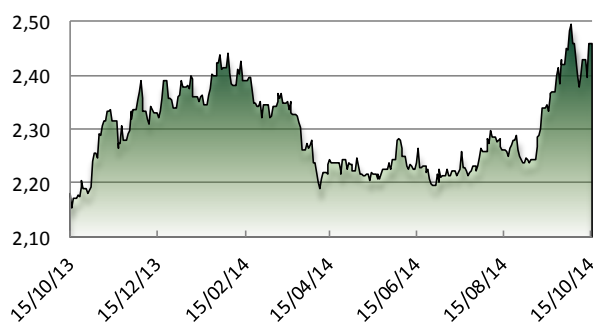
昨日公表されたIbope、Datafolhaの両調査機関による世論調査結果では、ルセフ大統領とネベス氏の支持率は共に43%対45%となり、引き続き拮抗した状況が示された。世論調査に対する警戒感に加え、ネベス氏が勝利した場合に財務相としての起用が有力視されているArminio Fraga氏が通貨スワップを利用した為替介入プログラムを中止する意向を示したことが、昨日のブラジルマーケットの変動幅を一層大きなものにした。世界的な景気後退懸念の拡大と大統領選の先行きという不透明な材料が重石となり、レアルを含む新興国通貨は目先ネガティブな影響を受けやすいと考えられる。

マーケットデータ

Indicator	Unit	10月14日	10月15日	前日比	9月15日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	44,57	43,11	-1,46	45,76	-2,65
USD / BRL Spot	BRL	2,4003	2,4576	+0,0573	2,3429	+0,1147
USD / JPY Spot	JPY	107,05	105,92	-1,13	107,19	-1,27
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	58.015	56.135	-1.880	57.949	-1.814
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	159,2	162,8	+3,6	147,0	+15,8
Brazil 10yrs Gov. Bond	%	11,27	11,56	+0,29	11,62	-0,06
DI Future Jan16 (金利先物)	%	11,85	11,95	+0,10	11,51	+0,44
3 Months US Dollar Libor	%	0,229	0,229	+0,000	0,235	-0,006
CRB Index (国際商品指数)	Index	273,9	271,3	-2,6	281,8	-10,5

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。

ドルレアススポットチャート



レアル円スポットチャート

