

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最近の新興国売り圧力が緩んで調整される動きとなりました。朝方はここまで下落率の高かったトルコリラや南アフリカランド等新興国通貨が持ち直したことからレアルも前日比レアル高の2.43台前半から始まりました。12月の鉱工業生産は予想を下回ったもののレアル買い戻しの調整圧力は続き2.41近辺へレアル高が進行しました。その後もレアル高値圏でもみ合いながらレアル買い戻し地合いは続き、結局2.40台半ばで引けています。

12月の鉱工業生産は前月比3.5%減と市場予想1.7%減を大幅に下回りました。内訳で最も大きく減少しているのが資本財生産で前月比11.6%の減少となっています。未だに投資への意欲が盛り上がっていないことを示すひとつの現象だと思われますが、これは単に利上げが続いているからという理由だけでなく投資主導型経済への転換期待が弱いことも示唆しているのでしょうか。昨日は特に大きな要因なくレアルを含めた新興国通貨が調整で戻ましたが、前日の貿易赤字に続き経済ファンダメンタルズが新興国選別のひとつの要因になっていくことは間違いない、レアル下落の圧力は未だに燻っていると考えるべきでしょう。

マーケットデータ

Indicator	Unit	2月3日	2月4日	前日比	1月4日	1ヶ月前比
BRL / JPY Spot	JPY	41,38	42,26	+0,88	44,12	-1,86
USD / BRL Spot	BRL	2,4403	2,4055	-0,0348	2,3765	+0,0290
USD / JPY Spot	JPY	100,98	101,64	+0,66	104,86	-3,22
Bovespa (ブラジル株価指数)	Index	46.148	46.964	+816	50.981	-4.017
CDS Brazil 5yrs (クレジットデフォルトスワップ)	bps	209,3	198,8	-10,5	189,0	+9,8
Brazil 5yrs Gov. Bond	%	13,28	13,14	-0,14	12,86	+0,28
DI Future Jan15 (金利先物)	%	11,73	11,57	-0,16	10,54	+1,03
3 Months US Dollar Libor	%	0,236	0,236	+0,000	0,240	-0,004
CRB Index (国際商品指数)	Index	283,6	286,4	+2,8	276,5	+9,9

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

