

# Banco de Tokyo-Mitsubishi UFJ Brasil S/A



## 1. マーケット・レート

			6月24日	6月25日	6月26日	6月27日	6月30日	Net Chg
Forex	USD/BRL	Spot	2,2250	2,2080	2,1970	2,1940	2,2140	+0,0200
	USD/YEN	Spot	101,96	101,86	101,73	101,39	101,32	-0,07
	EUR/USD	Spot	1,3607	1,3630	1,3609	1,3649	1,3693	+0,0044
	BRL/YEN	Spot	45,82	46,14	46,31	46,22	45,76	-0,46
Swap	Dollar Clean	6MTH(p.a.)	0,9120	0,9190	0,8860	0,8580	0,9010	+0,04
		1Year(p.a.)	1,1320	1,1420	1,1210	1,1270	1,1250	-0,00
	Real Interest	6MTH(p.a.)	10,76	10,77	10,78	10,78	10,77	-0,01
		1Year(p.a.)	10,91	10,87	10,89	10,88	10,89	+0,01
Stock	Bovespa		54.281	53.426	53.507	53.157	53.168	+11
Bond	CDS Brazil 5y		140,08	135,78	137,65	142,00	143,90	+1,90
	Global 40		111,825	111,775	111,750	111,675	111,650	-0,02

\* これらはインターバンク市場等におけるブラジル市場終了時のインデイケーションです。実際のレート提示は弊行担当アカウント・オフィサーまでお問い合わせ下さい。



## 2. 主要経済指標

イベント	予想	実績	前回
純債務対GDP比	34.4%	34.6%	34.2%
基礎的財政収支	-9.0B	-11.0B	16.9B



## 3. 要人コメント

なし	
----	--

## 4. 市況、トピックス

- 本日の為替相場は U\$1=R\$2.1940 で寄り付いた。
- 本日のレアルは高値となる U\$1=R\$2.1940 で寄り付いた後、正午にかけて 2.2000 を中心に小幅に推移した。
- しかし伯中銀が 7 月に満期を迎えるドル売り Swap ポジションを予想通り全てロールしないことが確認されたことを受けて 8 月分のスワップがどの程度ロールされるのかが市場で注目される展開となり、レアルは売りに転じた。
- 午後にかけてレアルはじりじりと下落、結局本日の安値となる U\$1=R\$2.2140 でクローズした。
- 尚、本日早朝に伯中銀による週間エコノミストサーベイが発表され、2014 年末の予想ドル・レアルは 2.40 に据え置かれたほか、2014 年度末の GDP 成長率は 1.16% から 1.10% に下方修正された。

当資料は相場情報の提供を唯一の目的としたもので、投資勧誘を目的としたものではありません。投資の最終決定は投資家ご自身の判断でなさるようにお願い致します。当資料は信頼できる情報源から得た情報に基づき作成したものですが、その情報の正確性、安全性を保証するものではありません。また、過去の結果が必ずしも将来の結果を暗示するものではありません。当資料は執筆者の見解に基づき作成されたものであり、弊社の統一された見解ではありません。当資料を使用することにより生ずるいかなる種類の損失についても弊社は責任を負いません。