

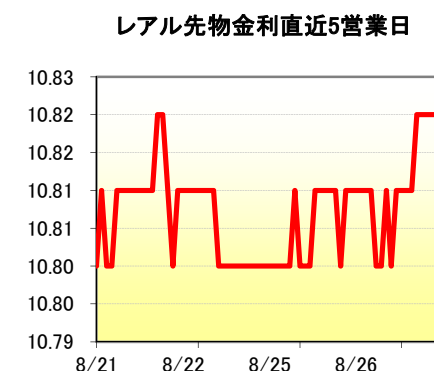
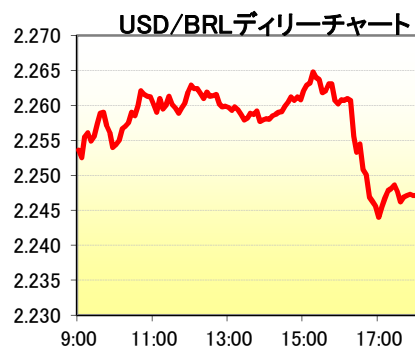
## Banco de Tokyo-Mitsubishi UFJ Brasil S/A



## 1. マーケット・レート

|       |               |             | 8月21日   | 8月22日   | 8月25日   | 8月26日   | 8月27日   | Net Chg |
|-------|---------------|-------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Forex | USD/BRL       | Spot        | 2.2690  | 2.2780  | 2.2890  | 2.2620  | 2.2470  | -0.0150 |
|       | USD/YEN       | Spot        | 103.85  | 103.95  | 104.06  | 104.06  | 103.88  | -0.18   |
|       | EUR/USD       | Spot        | 1.3281  | 1.3242  | 1.3193  | 1.3168  | 1.3194  | +0.0026 |
|       | BRL/YEN       | Spot        | 45.78   | 45.64   | 45.47   | 46.01   | 46.23   | +0.22   |
| Swap  | Dollar Clean  | 6MTH(p.a.)  | 1.1940  | 1.2220  | 1.2800  | 1.2060  | 1.0150  | -0.19   |
|       |               | 1Year(p.a.) | 1.4420  | 1.4610  | 1.5140  | 1.4580  | 1.2660  | -0.19   |
|       | Real Interest | 6MTH(p.a.)  | 10.90   | 10.89   | 10.89   | 10.89   | 10.89   | -0.00   |
|       |               | 1Year(p.a.) | 11.14   | 11.11   | 11.11   | 11.10   | 11.11   | +0.02   |
| Stock | Bovespa       |             | 58,992  | 58,407  | 59,735  | 59,821  | 60,951  | +1,129  |
| Bond  | CDS Brazil 5y |             | 140.17  | 143.00  | 140.80  | 135.19  | 132.25  | -2.94   |
|       | Global 40     |             | 110.150 | 110.100 | 110.175 | 110.050 | 110.150 | +0.10   |

\* 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ィケーションです。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     |
|--------------|----|--------|--------|
| PPI 製造業(前月比) | -- | -0.29% | -0.16% |
| PPI 製造業(前年比) | -- | 3.45%  | 5.01%  |

## 3. 要人コメント

|                       |   |
|-----------------------|---|
| ネベス大統領選挙候補<br>(社会民主党) | 現行政権のモデルは経済を損なっている。金融政策は完全に透明性を保つべきである。 |
|-----------------------|---|

## 4. 市況、トピックス

- 本日の為替相場は U\$1=R\$2. 2530 で寄り付いた。
- 特段の新規材料が無い中、昨日まで買われてきたレアルの利益確定の動きが見られ、レアルは寄付きから軟調に推移した。レアルは安値となる U\$1=R\$2. 2650 までジリ安となった。
- 10 月の大統領選挙で政権が交代がする可能性が高まっているとの報道を受けて、新政権への期待から伯主要株価指数は終日堅調に推移した。レアルも売り一巡後は再び選挙への期待感から反発し、本日の高値となる U\$1=R\$2. 2430 まで上昇した。
- 結局 U\$1=R\$2. 2470 でクローズした。

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。その情報の正確性、安全性を保障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。