



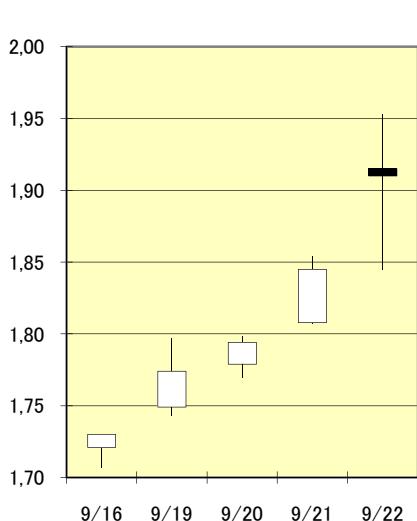
## ブラジル三菱東京UFJ銀行 DAILY MARKET REPORT

### 1. Market Rate

			9月16日	9月19日	9月20日	9月21日	9月22日	Net Chg
Forex	USD/REAL	Spot	1,7300	1,7740	1,7940	1,8450	1,9100	+0,0650
	USD/YEN	Spot	76,79	76,65	76,48	76,50	76,30	-0,20
	EURO/USD	Spot	1,3796	1,3621	1,3699	1,3567	1,3462	-0,0105
	REAL/YEN	Spot	44,39	43,21	42,63	41,46	39,95	-1,52
Swap	Dollar Clean	6MTH(p.a.)	2,96	2,72	2,76	2,83	3,68	+0,80
		1Year(p.a.)	3,22	3,12	3,13	3,17	3,86	+0,69
	Real Interest	6MTH(p.a.)	11,05	11,01	11,03	11,07	10,95	-0,12
		1Year(p.a.)	10,73	10,70	10,77	10,85	10,73	-0,12
Stock	Bovespa		57.210,11	57.102,78	56.378,63	55.981,90	53.280,28	-2.701,62
Bond	EMBI+(bp)		230,00	245,00	239,00	254,00	280,00	+26,00
	Global 40		136,550	135,750	135,500	134,500	134,2500	-0,2500

\* これは当社が行う取引市場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社担当アカウント・オフィサーまでお問い合わせ下さい。

直近5営業日U\$/R\$推移



U\$/R\$(2010/1/4～2011/9/22)



### 2. 市況、トピックス ( As of set-22 )

#### 【レアル大幅安、中銀大規模介入実施】

本日の為替相場はU\$1=R\$1.9150にてオープン。FOMC声明において米国経済の下振れリスクが指摘されたことを背景に欧州株価が大幅に下落する中、リスク回避の動きからレアルは寄り付きから急速に売られる展開となった。早々に1.95台へ軟化した後、当地中銀が急激なレアル安を回避する目的でスワップによる大規模な介入を実施、直後からレアルは急反発、1.84台半ばへ買い戻された。株価についても寄り付きから軟調に推移、午後にかけて54千ポイントを割り込んだ。朝方発表された当地失業率、米景気先行指数は予想比良好な結果となったものの段階材料視はされなかった。午後に入ると根強い世界経済の不透明感を背景にレアルは再び軟化、引けにかけて1.91近辺へ下落するとその後は同水準で揉み合いとなり、結局終値としては2009年7月以来の水準となるU\$1=R\$1.9100にてクローズ。