

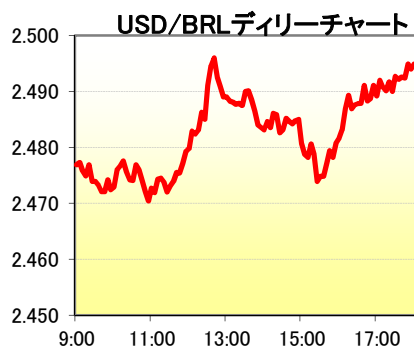
## Banco de Tokyo-Mitsubishi UFJ Brasil S/A



## 1. マーケット・レート

			9月25日	9月29日	9月30日	10月1日	10月2日	Net Chg
Forex	USD/BRL	Spot	2.4280	2.4480	2.4470	2.4810	2.4950	+0.0140
	USD/YEN	Spot	108.74	109.48	109.66	108.90	108.42	-0.48
	EUR/USD	Spot	1.2750	1.2686	1.2630	1.2622	1.2669	+0.0047
	BRL/YEN	Spot	44.79	44.73	44.82	43.89	43.46	-0.43
Swap	Dollar Clean	6MTH(p.a.)	1.0880	1.2020	1.2720	1.3600	1.3810	+0.02
		1Year(p.a.)	1.4070	1.5810	1.6230	1.7410	1.8690	+0.13
	Real Interest	6MTH(p.a.)	11.12	11.26	11.24	11.26	11.32	+0.05
		1Year(p.a.)	11.57	11.83	11.77	11.86	11.85	-0.01
Stock	Bovespa		55,962	54,625	54,116	52,858	53,519	+660
Bond	CDS Brazil 5y		161.00	177.64	175.30	177.14	175.83	-1.31
	Global 40		109.450	109.050	109.225	108.825	108.850	+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。



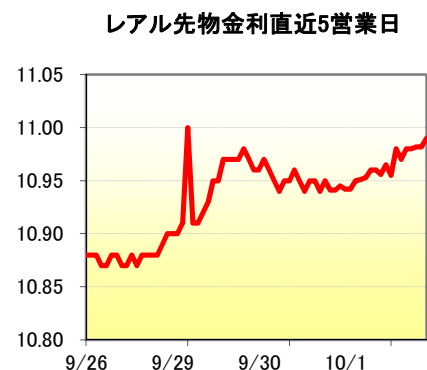
## 2. 主要経済指標

イベント	予想	実績	前回
FIPE消費者物価指数(月次)	0.11%	0.21%	0.34%
鉱工業生産(前月比)	0.1%	0.7%	0.7%
鉱工業生産(前年比)	-5.8%	-5.4%	-3.8%



## 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US\$1=R\$2.4840で寄り付いた。
- オープン前に開催されたECB理事会では、今月からカバード債の購入、年末までにABSの購入を開始し、少なくとも2年間購入を続けると発表された。しかし、具体的な購入金額への言及がなく市場の失望を買った。
- レアルは8月鉱工業生産が予想よりも強かったことを受けて、寄り付きからレアル買いが優勢となり、2.47台前半まで上昇した。しかし、直後に発表された米新規失業保険申請件数も予想より強かったことからドル買いも出て2.47台での揉み合いとなる中、本日の高値となるUS\$1=R\$2.4700をつけた。
- その後、明日の米雇用統計で強い数字が出るとの観測が広がり、ドルが買われ、レアルは本日の安値となるUS\$1=R\$2.4970まで急反落した。
- ECBを受けて欧州株が全面安となり、ボベスパ指数は7月以来の安値を試す展開となっていたが、利益確定の買戻しで午後からは前日比プラスに転じた。レアルは2.47台まで反発するも、Moody'sが伯金融システムの見通しをネガティブに引き下げたことを受け、引けにかけて反落し結局US\$1=R\$2.4950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。