



ブラジル三菱東京UFJ銀行 DAILY MARKET REPORT

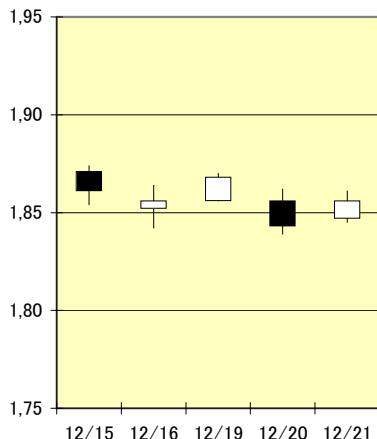
株式会社

1. Market Rate

			12月15日	12月16日	12月19日	12月20日	12月21日	Net Chg
Forex	USD/REAL	Spot	1,8610	1,8560	1,8680	1,8430	1,8560	+0,0130
	USD/YEN	Spot	77,91	77,83	77,99	77,89	78,09	+0,20
	EURO/USD	Spot	1,3019	1,3032	1,3004	1,3075	1,3048	-0,0027
	REAL/YEN	Spot	41,86	41,94	41,75	42,26	42,08	-0,19
Swap	Dollar Clean	6MTH(p.a.)	2,71	2,69	2,82	2,87	2,88	+0,01
		1Year(p.a.)	2,94	2,91	3,07	3,05	2,98	-0,07
	Real Interest	6MTH(p.a.)	10,11	10,09	10,08	10,07	10,05	-0,02
		1Year(p.a.)	9,91	9,91	9,91	9,89	9,84	-0,05
Stock	Bovespa		56.331,15	56.096,93	55.298,33	56.864,85	56.653,37	-211,48
	EMBI+(bp)		218,00	229,00	235,00	222,00	214,00	-8,00
Bond	Global 40		133,100	132,900	132,600	132,900	132,850	-0,0500

* 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。

直近5営業日U\$/R\$推移



U\$/R\$(2010/1/4～2011/12/21)



2. 市況、トピックス (As of dez-21)

【インフレ指標の落ち着きから金利先安感が強まり、レアルは売られる展開】

本日の為替相場はU\$1=R\$1.8470にてオープン。寄り付き早々に実施された欧州中央銀行（ECB）による初の3年物資金入札で応札額が事前予想を上回ると直後はユーロ買いが殺到し、リスク選好からレアルにも買いが入り、本日のレアル高値となる1.8450をつけた。しかし買い一巡後にユーロが反落に転じたことに加えて、9:00に発表されたブラジルの12月CPIでインフレの落ち着きが示されると、中銀による来年度の更なる利下げを織り込む格好で1年物の金利先物金利が下落し、レアルも反転売りに転じた。レアルは1.85を突破後もじりじりと値を下げながら続落し、正午過ぎに本日のレアル安値となる1.8610を示現した。その後はホリデーシーズン入りを前に徐々に流動性が低下する中、1.85台後半で動意に乏しい展開が続き、結局U\$1=R\$1.8560にてクローズ。