



2016年12月28日

Banco de Tokyo-Mitsubishi UFJ Brasil S/A

Treasury Department

Av. Paulista, 1274 – Bela Vista

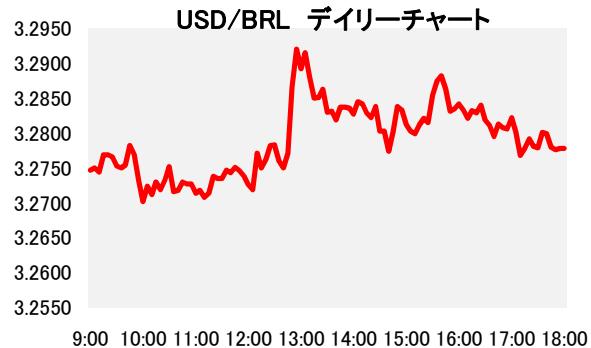
São Paulo - SP - 01310-925

1. マーケット・レート

| | | | 12月22日 | 12月23日 | 12月26日 | 12月27日 | 12月28日 | Net Chg |
|-----|---------------|-------------|---------|---------|--------|---------|---------|---------|
| 為替 | USD/BRL | Spot | 3.2910 | 3.2700 | 3.2800 | 3.2730 | 3.2770 | +0.0040 |
| | BRL/JPY | Spot | 35.73 | 35.86 | 35.69 | 35.88 | 35.75 | -0.13 |
| | EUR/USD | Spot | 1.0433 | 1.0452 | 1.0460 | 1.0457 | 1.0407 | -0.0050 |
| | USD/JPY | Spot | 117.62 | 117.27 | 117.10 | 117.45 | 117.19 | -0.26 |
| 金利 | Brazil DI | 6MTH(p.a.) | 12.441 | 12.447 | 12.436 | 12.427 | 12.406 | -0.021 |
| | Future | 1Year(p.a.) | 11.614 | 11.604 | 11.588 | 11.564 | 11.550 | -0.014 |
| | On-shore | 6MTH(p.a.) | 2.415 | 2.367 | 2.356 | 2.420 | 2.515 | +0.095 |
| | USD | 1Year(p.a.) | 2.589 | 2.591 | 2.577 | 2.614 | 2.615 | +0.001 |
| 株式 | Bovespa指数 | | 57255 | 58056 | 58620 | 58697 | 59782 | 1,085 |
| CDS | CDS Brazil 5y | | 283.01 | 282.73 | 279.27 | 282.33 | 280.83 | -1.50 |
| 商品 | CRB指数 | | 190.309 | 190.529 | 休場 | 192.753 | 193.033 | +0.28 |

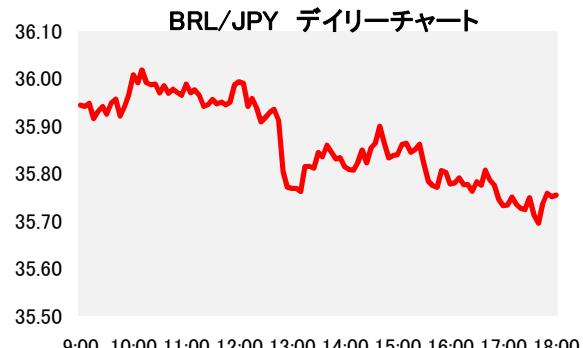
* これらはインバウンド市場等におけるブランク市場終了時のインデックスーションです。実際のレート提示は弊社担当アカウント・オフィサーまでお問い合わせ下さい。

2. 主要經濟指標



3.要人コメント

| | |
|------|---|
| 伯財務省 | テメル大統領は各州から連邦政府への負債の支払いを猶予する法案に対して部分的に拒否権を発動する予定。 |
|------|---|



4. トピックス

- 本日のレアルは3.2710で寄り付いた。朝方に日中高値となる3.2670を付けると、年末を控えてマーケットが換算となる中、3.27台半ばから後半のレンジ内取引となった。午後に入ると大口の売りが出た模様でレアルは安値3.2950を示現。しかし引けにかけては値を戻し、結局3.2770でクローズ。
 - イラク石油相が1月初めから日量20万から21万バレルの減産を実施すると表明し、ベネズエラの石油省も1月から日量9.5万バレルの減産計画を明らかにした。これを受けて原油価格は上昇し、WTI先物は一時54ドル台前半まで上昇。終値も8営業日続伸となった。原油高を受けてボーベスパ指数も前日比1.9%上昇し、4営業日続伸した。