お客様各位

2012年1月3日

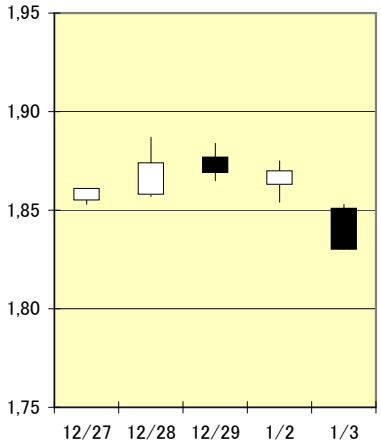
ブラジル三菱東京UFJ銀行 DAILY MARKET REPORT

1.Market Rate

			12月27日	12月28日	12月29日	1月2日	1月3日	Net Chg
Forex	USD/REAL	Spot	1,8610	1,8740	1,8690	1,8700	1,8300	-0,0400
	USD/YEN	Spot	77,86	77,92	77,63	76,88	76,65	-0,23
	EURO/USD	Spot	1,3073	1,2936	1,2959	1,2932	1,3051	+0,0119
	REAL/YEN	Spot	41,84	41,58	41,53	41,11	41,88	+0,77
Swap	Dollar Clean	6MTH(p.a.)	2,72	2,67	2,50	2,57	2,39	-0,19
		1Year(p.a.)	2,93	2,87	2,80	2,85	2,73	-0,12
	Real Interest	6MTH(p.a.)	10,20	10,18	10,17	10,14	10,14	u,c,
		1Year(p.a.)	10,10	10,06	10,04	10,02	10,04	+0,02
Stock	Bovespa		58.005,20	56.533,76	56.754,08	57.829,27	59.264,87	+1.435,60
Bond	EMBI+(bp)		209,00	218,00	222,00	223,00	214,00	-9,00
	Global 40		132,900	132,850	132,500	132,800	133,200	+0,4000

＊これらはｲﾝﾀｰﾊﾞﾝｸ市場等におけるﾌﾞﾗｼﾞﾙ市場終了時のｲﾝﾃﾞｨｹｰｼｮﾝです。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。

直近5営業日U$/R$推移



U$/R$ (2010/1/4～2012/1/3)

2.市 況 、ﾄﾋﾟｯｸｽ（ As of jan－03 ）

【世界的な製造関連指標の改善を受けて市場のリスク許容度が高まり、レアルも大きく反発】

本日の為替相場はU$1=R$1.8510にてオープン。本日から米英市場が休暇明けとなり市場参加者が戻ってくる中、オーバーナイト市場で商品先物が全般的に上昇。年末年始に発表されたアジア諸国の製造業指標が予想を上回ったことも投資家のリスク許容度を高め、レアルは寄付きから買いが先行した。ブラジル時間13:00に発表予定の米製造指標も強めの結果が予想され、レアルをサポート。また、欧州時間に発表された予想を下回る12月独失業率等を好感してユーロドルが堅調に推移したことも間接的にレアル買いを支援し、正午にかけてレアルはじり高の展開となった。午後に入り発表された米製造指標が強めの予想をも上回ると、更なるレアル買いに拍車がかかり、15:00過ぎに本日のレアル高値となるU$1=R$1.8300を示現した。その後は本日の高値近辺で強含みながら推移し、結局昨日終値比で2%以上上昇となるU$1=R$1.8300にてクローズ。

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にお願い致します。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が、その情報の正確性、安全性を保証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。なお、当資料の無断複製、複写、転送はご遠慮ください。当方の都合で、本レポートの全部または一部を予告なしに変更することがありますので、予めご了承ください。

Banco de Tokyo-Mitsubishi UFJ Brasil S/A　Tesouraria　G. Asano