2017年1月3日

Banco de Tokyo-Mitsubishi UFJ Brasil S/A
Treasury Department
Av. Paulista, 1274 – Bela Vista
São Paulo, SP – 01310-925

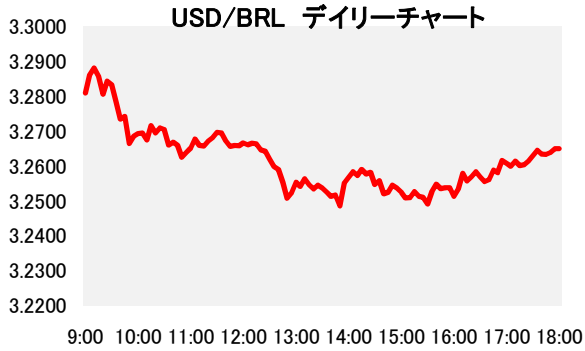
1. マーケット・レート

			12月28日	12月29日	12月30日	1月2日	1月3日	Net Chg
為替	USD/BRL	Spot	3.2770	3.2530	休場	3.2850	**3.2650**	-0.0200
	BRL/JPY	Spot	35.75	35.85	休場	35.78	**36.05**	+0.27
	EUR/USD	Spot	1.0407	1.0483	1.0548	1.0460	**1.0407**	-0.0053
	USD/JPY	Spot	117.19	116.64	116.79	117.59	**117.70**	+0.11
金利	Brazil DI Future	6MTH(p.a.)	12.406	12.420	休場	12.332	**12.327**	-0.005
		1Year(p.a.)	11.550	11.516	休場	11.431	**11.443**	+0.012
	On-shore USD	6MTH(p.a.)	2.515	2.317	休場	2.216	**2.159**	-0.057
		1Year(p.a.)	2.615	2.563	休場	2.461	**2.420**	-0.041
株式	Bovespa指数		59782	60227	休場	59589	**61814**	2,225
CDS	CDS Brazil 5y		280.83	279.67	280.81	280.60	**278.02**	-2.58
商品	CRB指数		193.033	192.897	193.176	休場	**190.146**	-3.03

＊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。

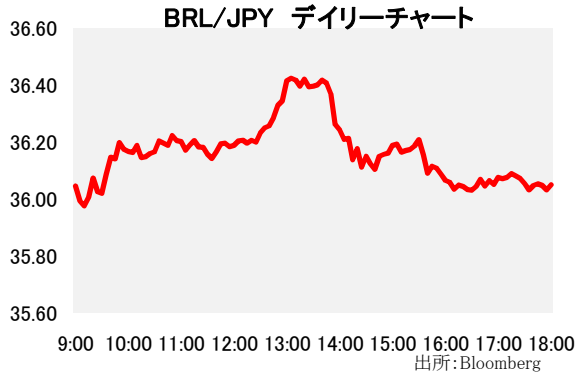
2.主要経済指標

イベント	予想	実績	前回
(米)ﾏｰｸｲｯﾄ米国製造業PMI	54.2	54.3	54.2
(米)ISM製造業景況指数	53.8	54.7	53.2
(米)建設支出(前月比)	0.5%	0.9%	0.6%



3.要人コメント

マイア伯下院議長	年金改革法案は3月までに下院を通過し、6月までに上院で採決が行われるだろう。



出所：Bloomberg

4.トピックス

- 本日のレアルは3.2860で寄り付き、直後に日中安値となる3.2910を示現した。下院議長が、3月までに年金改革法案が下院を通過するとの見解を示したことを受けてレアルは堅調に推移。大口の資金流入と思しきレアル買いもあり、他の中南米通貨が軟調推移する中で、レアルは逆にジリ高の展開となった。日中高値3.2480まで上昇し、結局、3.2650でクローズ。
- 12月の米ISM製造業景況指数は市場予想を大きく上回り、4ケ月連続の上昇となった。ドルは対ユーロで14年ぶりの高値を示現した。
- WTI先物は朝方55ドル台前半をつけ、2017年7月以来の高値まで上昇したが、その後のドル高を受けて52ドル台半ばまで急反落した。

当資料は一般的な情報提供のみを目的として作成されたものであり、特定のお客様のニーズ、財務状況又は投資対象に対応することを意図しておりません。また、当資料は、適用法令上許容される範囲内でのみ利用可能であり、当資料の頒布を制約する法令が存在する地域の方によって利用されることを意図しておりません。当資料内のいかなる情報又は意見も、預金、有価証券、デリバティブ取引その他の金融商品の売買、投資、保有などを勧誘又は推奨するものではありません。 資料は信頼できると思われる情報に基づいて作成されていますが、当行はその正確性、適時性、適切性又は完全性を表明又は保証するものではなく、当行、その子会社又は関連会社は、お客様による当資料の利用等に関して生じうるいかなる損害についても責任を負いません。ご利用に関しては、すべて お客様御自身でご判断下さいますよう、宜しくお願い申し上げます。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。当資料の内容は予告なしに変更することがあり、また、当行、その子会社又は関連会社は、当資料を更新する義務を負っておりません。また、当資料は 著作物であり、著作権法により保護されております。当行の書面による許可なく複製又は第三者、個人顧客もしくは一般投資家への配布をすることはできません。