



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

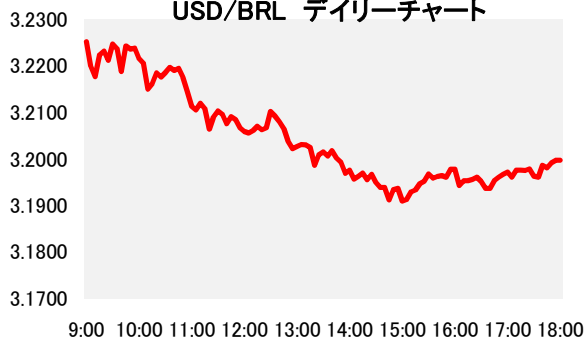
| | | | 1月3日 | 1月4日 | 1月5日 | 1月6日 | 1月9日 | Net Chg |
|-----|---------------|-------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 為替 | USD/BRL | Spot | 3.2650 | 3.2210 | 3.1980 | 3.2220 | 3.1990 | -0.0230 |
| | BRL/JPY | Spot | 36.05 | 36.50 | 36.14 | 36.31 | 36.27 | -0.04 |
| | EUR/USD | Spot | 1.0407 | 1.0468 | 1.0592 | 1.0530 | 1.0576 | +0.0046 |
| | USD/JPY | Spot | 117.70 | 117.56 | 115.60 | 117.01 | 116.05 | -0.96 |
| 金利 | Brazil DI | 6MTH(p.a.) | 12.327 | 12.315 | 12.197 | 12.181 | 12.154 | -0.027 |
| | Future | 1Year(p.a.) | 11.443 | 11.477 | 11.349 | 11.354 | 11.330 | -0.024 |
| | On-shore | 6MTH(p.a.) | 2.159 | 2.119 | 2.094 | 2.039 | 2.056 | +0.017 |
| | USD | 1Year(p.a.) | 2.420 | 2.355 | 2.384 | 2.336 | 2.367 | +0.031 |
| 株式 | Bovespa指数 | | 61814 | 61589 | 62071 | 61665 | 61700 | 35 |
| CDS | CDS Brazil 5y | | 278.02 | 265.89 | 258.09 | 259.00 | 259.61 | +0.61 |
| 商品 | CRB指数 | | 190.146 | 192.977 | 193.706 | 193.541 | 190.605 | -2.94 |

* 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. 主要経済指標

| イベント | 予想 | 実績 | 前回 |
|---------------|-------|--------|---------|
| FGV CPI IPC-S | 0.47% | 0.50% | 0.33% |
| 貿易収支(週次) | -- | \$222m | \$1413m |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |

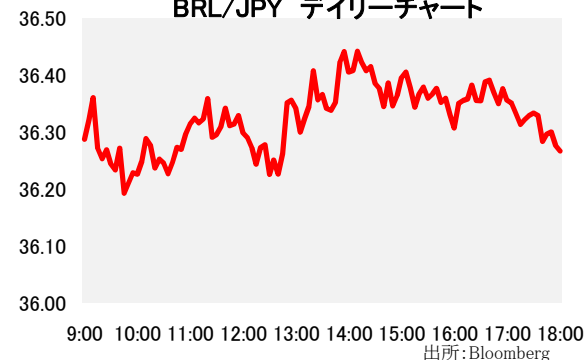
USD/BRL デイリーチャート



3. 要人コメント

| | |
|----------|---|
| メイレス伯財務相 | リオデジャネイロ州の再生計画は水曜日に発表される予定。州政府の連邦政府向け債務について再交渉を行った。 |
|----------|---|

BRL/JPY デイリーチャート



4. トピックス

- 本日のレアルは3.2240で寄り付き、直後に日中安値となる3.2310をつけた。特段の新しいニュースはなかったが、海外市場でドル売りが進んだ流れを受けて、レアルは終日ジリ高の展開。日中高値3.1990まで上昇し、結局3.1990でクローズ。
- 伯中銀公表のエコノミスト予想集計では、2016年の経済成長率予想が▲3.49%、2017年予想が0.50%に据え置かれた。2016年のインフレ率予想は6.38%から6.35%に9週連続で下方修正され、2017年予想は4.87%から4.81%に下方修正された。2017年間の政策金利予想は10.25%で据え置かれ、年末の為替レート予想は3.48から3.45へ2週連続でレアル高方向に修正された。
- イラク南部からの原油輸出が増加したとの報道を受けて原油価格は大幅下落。WTI先物は53ドル台後半から52ドル割れまで下落した。

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さ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、宜しくお願ひ申し上げます。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います。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。