



Banco de Tokyo-Mitsubishi UFJ Brasil S/A

Treasury Department
Av. Paulista, 1274 – Bela Vista
São Paulo, SP – 01310-925

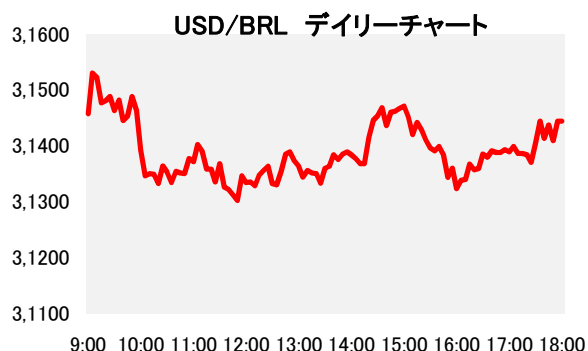
1. マーケット・レート

| | | | 8月5日 | 8月8日 | 8月9日 | 8月10日 | 8月11日 | Net Chg |
|-----|---------------|-------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 為替 | USD/BRL | Spot | 3.1650 | 3.1720 | 3.1450 | 3.1270 | 3.1440 | +0.0170 |
| | BRL/JPY | Spot | 32.17 | 32.28 | 32.39 | 32.34 | 32.43 | +0.09 |
| | EUR/USD | Spot | 1.1086 | 1.1085 | 1.1114 | 1.1182 | 1.1137 | -0.0045 |
| | USD/JPY | Spot | 101.82 | 102.42 | 101.87 | 101.15 | 101.97 | +0.82 |
| 金利 | Brazil DI | 6MTH(p.a.) | 13.860 | 13.862 | 13.822 | 13.829 | 13.839 | +0.009 |
| | Future | 1Year(p.a.) | 13.186 | 13.190 | 13.106 | 13.081 | 13.118 | +0.037 |
| | On-shore | 6MTH(p.a.) | 2.114 | 2.319 | 2.177 | 2.167 | 2.111 | -0.056 |
| | USD | 1Year(p.a.) | 2.290 | 2.455 | 2.304 | 2.386 | 2.337 | -0.050 |
| 株式 | Bovespa指数 | | 57661 | 57635 | 57689 | 56920 | 58300 | 1.380 |
| CDS | CDS Brazil 5y | | 268.40 | 270.60 | 267.60 | 262.37 | 258.31 | -4.06 |
| 商品 | CRB指数 | | 181.799 | 182.795 | 181.430 | 179.549 | 181.990 | +2.44 |

* 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。

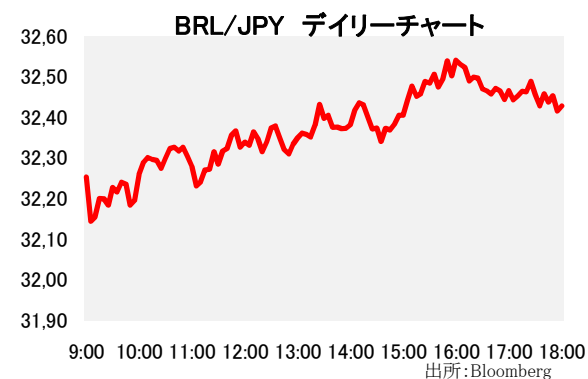
2. 主要経済指標

| イベント | 予想 | 実績 | 前回 |
|-------------------|-------|-------|-------|
| IBGEサービス部門売上高 前年比 | -4.6% | -3.4% | -6.1% |
| (米)輸入物価指数(前月比) | -0.4% | 0.1% | 0.6% |
| (米)新規失業保険申請件数 | 265k | 266k | 267k |
| (米)失業保険継続受給者数 | 2133k | 2155k | 2141k |
| (米)ブルームバーグ消費者信頼感 | -- | 41.8 | 43.0 |
| | | | |
| | | | |



3. 要人コメント

| | |
|-----------|--------------|
| メイレス伯中銀総裁 | 財政収支目標は達成される |
|-----------|--------------|



4. トピックス

- 本日のレアルは日中高値となる3.1270で寄り付いたが、伯中銀がドル買い介入の金額を5億ドルから7.5億ドルに増額したことを受けてレアルは一気に本日の安値となる3.1540まで反落した。しかし原油先物価格が急反発したことを受けて、リスク資産買いが見られると、レアルも3.13台半ばまで買い戻された。その後特段材料に乏しい展開となり、レアルは小幅に推移した後、結局3.1440でクローズした。
- サウジアラビアのエネルギー相は9月にOPEC非公式会議で市場を安定させるための行動について話し合う可能性があるとして述べたことで、WTI原油先物が急反発、3週間振り高値で引けた。
- 原油価格の上昇を受けて国内ではボブスバ指数が約2.5%上昇、2年振りの高値圏まで到達した。

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せう、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 著作権であり、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。