



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

| | | | 9月27日 | 9月28日 | 9月29日 | 10月2日 | 10月3日 | Net Chg |
|-----|---------------|-------------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------|---------|
| 為替 | USD/BRL | Spot | 3.1930 | 3.1830 | 3.1630 | 3.1550 | 3.1440 | -0.0110 |
| | BRL/JPY | Spot | 35.33 | 35.29 | 35.57 | 35.73 | 35.90 | +0.17 |
| | EUR/USD | Spot | 1.1750 | 1.1787 | 1.1814 | 1.1736 | 1.1744 | +0.0008 |
| | USD/JPY | Spot | 112.80 | 112.28 | 112.51 | 112.73 | 112.87 | +0.14 |
| 金利 | Brazil DI | 6MTH(p.a.) | 7.210 | 7.202 | 7.174 | 7.155 | 7.155 | -0.001 |
| | Future | 1Year(p.a.) | 7.145 | 7.168 | 7.140 | 7.140 | 7.160 | +0.020 |
| | On-shore | 6MTH(p.a.) | 2.394 | 2.911 | 2.282 | 2.213 | 2.198 | -0.015 |
| | USD | 1Year(p.a.) | 2.522 | 2.762 | 2.424 | 2.378 | 2.378 | u.c. |
| 株式 | Bovespa指数 | 73,796.69 | 73,567.25 | 74,293.50 | 74,359.81 | 76,762.94 | 2,403.13 | |
| CDS | CDS Brazil 5y | 203.13 | 199.85 | 195.95 | 193.14 | 188.20 | -4.94 | |
| 商品 | CRB指数 | 183.861 | 182.990 | 183.088 | 180.909 | 180.898 | -0.01 | |

* 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 |
|---------------|------|---------|---------|
| 鉱工業生産(前月比) | 0.0% | -0.8% | 0.7% |
| 鉱工業生産(前年比) | 4.8% | 4.0% | 2.9% |
| CNI設備稼働率(季調済) | -- | 77.8% | 77.5% |
| 自動車販売台数 | -- | 199,227 | 216,534 |
| | | | |
| | | | |
| | | | |

3. 要人コメント

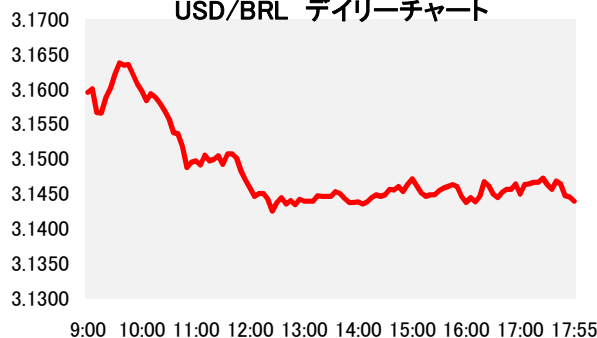
| |
|----|
| なし |
|----|

4. トピックス

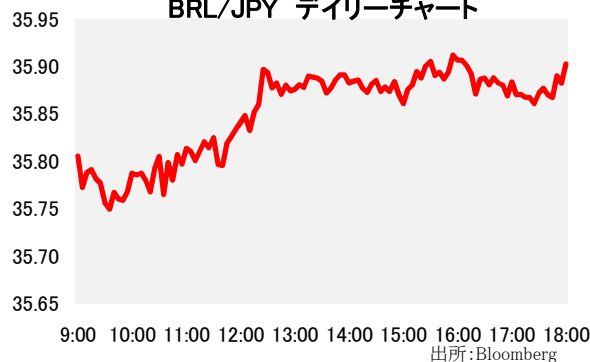
- 本日のリアルは3.1560で寄り付いた。その後、伯鉱工業生産が予想を下回ったことから本日の安値となる3.1650まで下落。しかし直後から海外でリスク資産買いが優勢となったほか、伯財務省が海外での国債発行を発表したことが好感されるとリアルは日中高値となる3.1420まで買い戻された。午後の取引は同水準でのみ合いが続き、小幅に推移した後、結局3.1440でクローズした。
- 伯財務相は2028年満期の国債を発行すると発表、発行金額は20億ドルを越えると市場では予想している。
- ボベスパ指数は3%以上の大幅高。一般消費材やエネルギー銘柄を中心に全銘柄が上昇した。

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。

USD/BRL デイリーチャート



BRL/JPY デイリーチャート



出所: Bloomberg