



Banco de Tokyo-Mitsubishi UFJ Brasil S/A

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

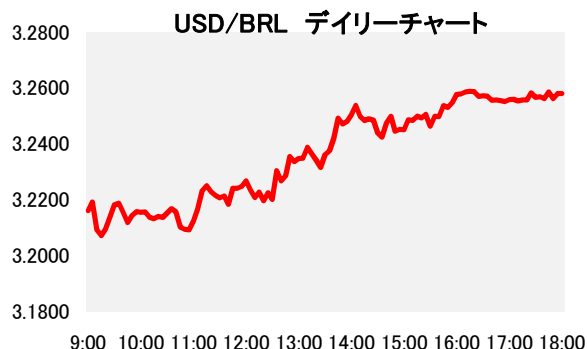
1. マーケット・レート

| | | | 9月28日 | 9月29日 | 9月30日 | 10月3日 | 10月4日 | Net Chg |
|-----|---------------|-------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 為替 | USD/BRL | Spot | 3.2160 | 3.2590 | 3.2620 | 3.2090 | 3.2580 | +0.0490 |
| | BRL/JPY | Spot | 31.30 | 30.99 | 31.08 | 31.67 | 31.58 | -0.09 |
| | EUR/USD | Spot | 1.1216 | 1.1223 | 1.1240 | 1.1212 | 1.1204 | -0.0008 |
| | USD/JPY | Spot | 100.69 | 101.03 | 101.33 | 101.64 | 102.90 | +1.26 |
| 金利 | Brazil DI | 6MTH(p.a.) | 13.318 | 13.346 | 13.338 | 13.257 | 13.294 | +0.037 |
| | Future | 1Year(p.a.) | 12.500 | 12.513 | 12.507 | 12.388 | 12.418 | +0.030 |
| | On-shore | 6MTH(p.a.) | 2.218 | 2.183 | 2.034 | 2.041 | 1.928 | -0.113 |
| | USD | 1Year(p.a.) | 2.193 | 2.182 | 2.161 | 2.167 | 2.214 | +0.047 |
| 株式 | Bovespa指数 | | 59356 | 58351 | 58367 | 59461 | 59339 | -122 |
| CDS | CDS Brazil 5y | | 267.35 | 275.60 | 272.78 | 267.84 | 275.92 | +8.08 |
| 商品 | CRB指数 | | 185.903 | 185.828 | 186.316 | 187.030 | 187.304 | +0.27 |

* 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。

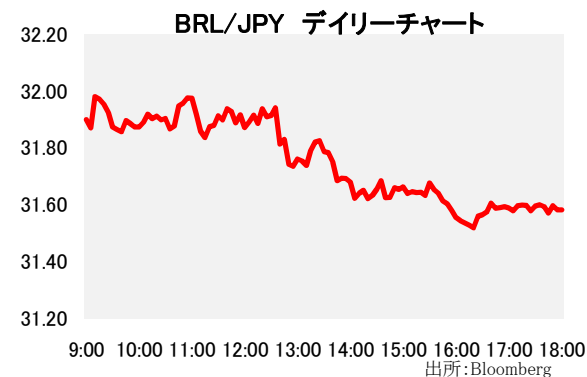
2. 主要経済指標

| イベント | 予想 | 実績 | 前回 |
|-----------------|--------|--------|-------|
| FIPE消費者物価指数(月次) | -0.02% | -0.14% | 0.11% |
| 鉱工業生産(前月比) | -3.20% | -3.80% | 0.10% |
| 鉱工業生産(前年比) | -4.8% | -5.2% | -6.4% |
| (米)ISMニューヨーク | -- | 49.60 | 47.50 |
| | | | |
| | | | |
| | | | |



3. 要人コメント

| | |
|-------------------|--|
| ゴールドファイン 伯中銀総裁 | 前もって決まった金融緩和(利下げ)の予定はない、全ての決断はCOPO Mで行われる。 |
|-------------------|--|



4. トピックス

- 本日のレアルは3.2120で寄り付き後、朝方は買いが優勢となり、直ぐさま日中高値となる3.2080を付けた。しかし、伯鉱工業生産が予想を大きく下回ったことを嫌気しレアルはじりじりと反落。引け間際に本日の安値となる3.2600まで下落し、結局3.2580でクローズした。
- リッチモンド連銀のラッカー総裁がインフレ加速の可能性を阻止するために利上げを強く求めたほか、クリーブランド連銀のマスター総裁が昨日、米経済に利上げの機が熟していると発言したこともあり、年内利上げの観測が強まった。ドルは主要通貨の大半に対して値上がりしている。

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。