



1. マーケット・レート

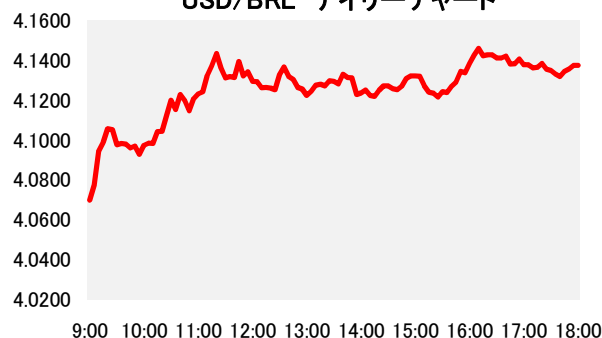
| | | | 8月22日 | 8月23日 | 8月24日 | 8月27日 | 8月28日 | Net Chg |
|-----|---------------|-------------|-----------|-----------|-----------|-----------|------------------|---------|
| 為替 | USD/BRL | Spot | 4.0430 | 4.1150 | 4.1050 | 4.0820 | 4.1370 | +0.0550 |
| | BRL/JPY | Spot | 27.350 | 27.040 | 27.09 | 27.21 | 26.88 | -0.33 |
| | EUR/USD | Spot | 1.1595 | 1.1539 | 1.1622 | 1.1678 | 1.1697 | +0.0019 |
| | USD/JPY | Spot | 110.56 | 111.27 | 111.23 | 111.08 | 111.19 | +0.11 |
| 金利 | Brazil DI | 6MTH(p.a.) | 7.004 | 7.170 | 7.150 | 7.118 | 7.188 | +0.070 |
| | Future | 1Year(p.a.) | 7.878 | 8.121 | 8.038 | 7.992 | 8.049 | +0.057 |
| | On-shore | 6MTH(p.a.) | 4.039 | 4.091 | 4.087 | 4.006 | 3.855 | -0.151 |
| | USD | 1Year(p.a.) | 4.531 | 4.577 | 4.580 | 4.531 | 4.463 | -0.067 |
| 株式 | Bovespa指数 | | 76,902.31 | 75,633.77 | 76,262.23 | 77,929.68 | 77,473.19 | -456.49 |
| CDS | CDS Brazil 5y | | 264.61 | 279.12 | 285.99 | 285.75 | 291.00 | +5.26 |
| 商品 | CRB指数 | | 191.120 | 190.498 | 192.080 | 192.867 | 191.712 | -1.16 |

* 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。

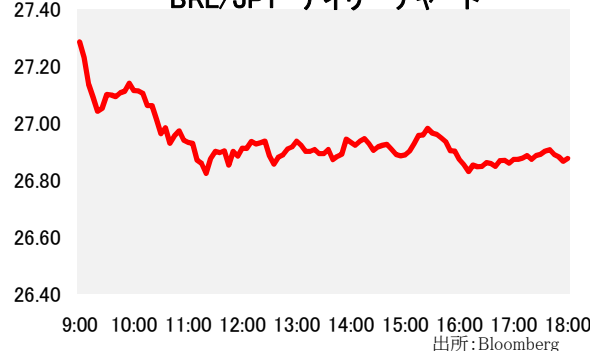
2. 主要経済指標

| イベント | 予想 | 実績 | 前回 |
|-----------------------|-------|-------|-------|
| (米)卸売在庫(前月比) | 0.2% | 0.7% | 0.1% |
| (米)コンファレンス・ボード 消費者信頼感 | 126.6 | 133.4 | 127.4 |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |

USD/BRL デイリーチャート



BRL/JPY デイリーチャート



3. 要人コメント

| |
|----|
| なし |
|----|

4. トピックス

- 本日のレアルは4.0790で寄付き、直後に日中高値4.0670を付けた。朝方から売りの動きが見られたレアルは、堅調な米国の経済指標の結果を受けてドルが主要通貨に対して買われると、正午前に直近安値を更新する4.14台まで下落した。その後、新たな国内材料に乏しい中、午後にかけて4.13近辺の揉み合いが継続。取引終盤に日中安値4.1460を付けたレアルは、結局4.1370でクローズした。
- 本日発表された8月の米消費者信頼感指数は市場予想を上回り、2000年10月以来の高水準となった。これを受けて米金利は上昇し、ドルが主要通貨に対して上昇する形となった。
- 直近安値を更新するまで売りが進んだレアルであったが、本日も伯中銀は既存ポジション2.4億ドルのロールオーバー以外に追加のドル売りスワップ入札を実施しなかった。

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せよう、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。