



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26日	1月29日	1月30日	1月31日	2月1日	Net Chg
為替	USD/BRL	Spot	3.1480	3.1560	3.1810	3.1870	3.1700	-0.0170
	BRL/JPY	Spot	34.52	34.50	34.19	34.23	34.52	+0.29
	EUR/USD	Spot	1.2421	1.2388	1.2405	1.2416	1.2508	+0.0092
	USD/JPY	Spot	108.70	108.95	108.78	109.10	109.40	+0.30
金利	Brazil DI	6MTH(p.a.)	6.624	6.630	6.633	6.618	6.622	+0.004
	Future	1Year(p.a.)	6.862	6.881	6.909	6.907	6.920	+0.013
	On-shore	6MTH(p.a.)	2.485	2.458	2.457	2.439	2.430	-0.009
	USD	1Year(p.a.)	2.750	2.731	2.726	2.710	2.729	+0.019
株式	Bovespa指数		85,530.81	84,698.02	84,482.44	84,912.70	85,495.25	582.55
CDS	CDS Brazil 5y		142.80	144.45	145.78	143.56	144.84	+1.28
商品	CRB指数		200.520	199.536	198.136	197.376	198.347	+0.97

* 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	0.65%	0.69%	0.59%
鉱工業生産(前月比)	2.00%	2.80%	0.20%
鉱工業生産(前年比)	3.40%	4.30%	4.70%
マーケット・ブラジルPMI製造業	--	51.2	52.4
貿易収支(月次)	\$2900m	\$2768m	\$4998m
(米)新規失業保険申請件数	235k	230k	233k
(米)失業保険継続受給者数	1929k	1953k	1937k
(米)ISM製造業景況指数	58.6	59.1	59.7

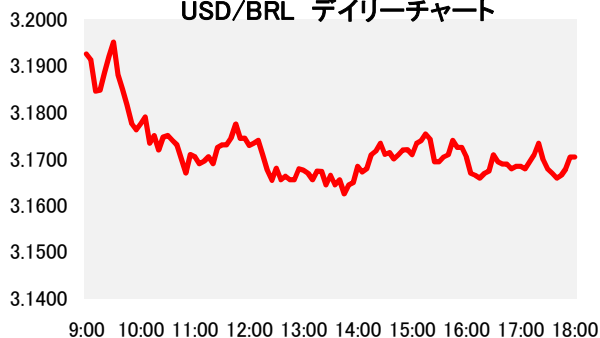
3. 要人コメント

なし

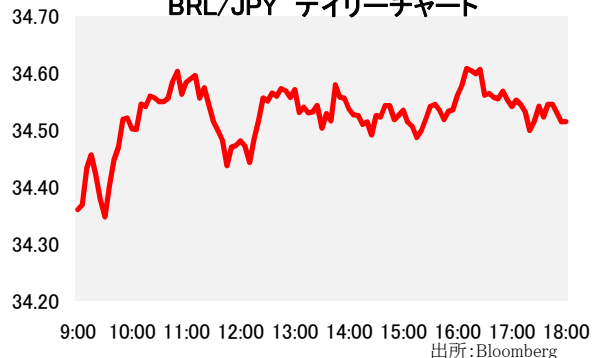
4. トピックス

- 本日のレアルは3.1940で寄り付き、直後に日中安値3.1960を付けた。その後、大口の資金流入と思しきフローから3.17近辺へと上昇。国外のリスクオンムードに支えられ堅調な推移が続く、午後に入って日中高値3.1620付けた。その後は目立った国内材料が無い中で3.17近辺での揉み合いが続き、結局3.1700でクローズした。
- 本日発表された米ISM製造業景況指数は前月から低下。市場予想は上回ったものの、雇用指数が8ヶ月振りの水準まで低下したこともあり、市場ではドルが売られた。
- ボベスパ指数は続伸。引き続き国外のリスクオンムードを背景に堅調推移が続いた。

USD/BRL デイリーチャート



BRL/JPY デイリーチャート



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。