



## Banco de Tokyo-Mitsubishi UFJ Brasil S/A

Treasury Department

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

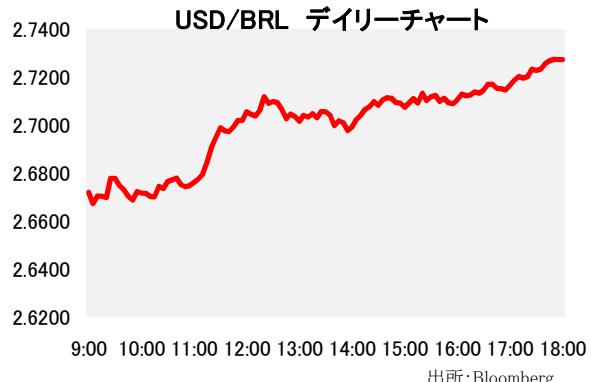
## 1. マーケット・レート

			1月27日	1月28日	1月29日	1月30日	2月2日	Net Chg
為替	USD/BRL	Spot	2.5740	2.5770	2.6040	2.6830	2.7270	+0.0440
	BRL/JPY	Spot	45.77	45.67	45.43	43.80	43.00	-0.80
	EUR/USD	Spot	1.1375	1.1309	1.1309	1.1293	1.1342	+0.0049
	USD/JPY	Spot	117.80	117.69	118.37	117.49	117.27	-0.22
金利	Brazil DI Future	6MTH(p.a.) 1Year(p.a.)	12.555 12.655	12.551 12.675	12.546 12.665	12.614 12.780	12.688 12.852	+0.073 +0.072
	On-shore USD	6MTH(p.a.) 1Year(p.a.)	1.712 2.108	1.618 2.000	1.580 1.960	1.517 2.000	1.716 2.193	+0.199 +0.193
株式	Bovespa指数		48,591	47,695	47,762	46,908	47,651	743
CDS	CDS Brazil 5y		199.87	208.70	212.70	226.50	235.86	+9.36
商品	CRB指数		217.913	214.987	212.643	218.840	220.440	+1.60

\* 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。

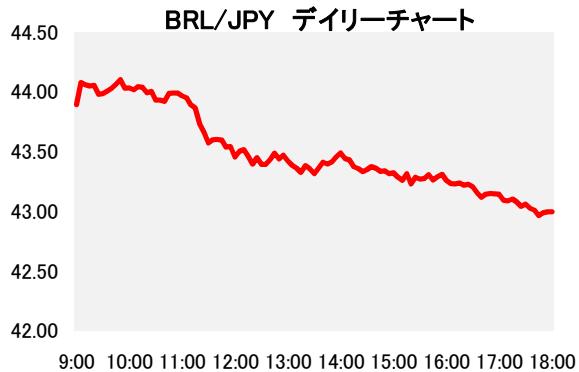
## 2. 主要経済指標

イベント	予想	実績	前回
FGV CPI IPC-S	1.65%	1.73%	1.51%
HSBC製造業PMI	--	50.7	50.2
貿易収支(週次)	-\$3000M	-\$3174M	\$293M
(米)個人所得	0.2%	0.3%	0.3%
(米)個人支出	-0.2%	-0.3%	0.5%
(米)ISM製造業景況指数	54.5	53.5	55.1



## 3. 要人コメント

なし	
----	--



## 4. トピックス

- 本日のドルレアルは2.6820で寄り付いた。中銀による為替介入プログラムにおいて、ドル売りポジションのロールオーバー金額が先週末のアナウンス通り増額されたことを受けてレアルは高値となる2.6670まで反発した。しかし、その後は先週のレビューア財務相の発言を受けてレアルは軟調推移した。原油価格の反発を背景にボベスパ指数は上昇したが、レアルは終日売られた。引け間際に本日の安値となる2.7280を示現し、2.7270でクローズした。
- 朝方発表された伯中銀によるアナリスト調査では2015年のGDP成長率予想が0.13%から0.03%へ5週連続で引き下げられ、2016年も1.54%から1.50%に引き下げられた。一方、インフレ率は2015年末予想が6.99%から7.01%に引き上げられた。
- 米1月ISM製造業景況指数は1年ぶりの低水準となり、予想を大きく下回った。特にドル高の影響で輸出受注指数は49.5と2012年11月以降で初めて50を下回った。
- 原油価格は米石油労働者のストライキが2日目に入ったことを受けて上昇した。全米規模のストは1980年以来。

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ご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する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、すべてお客様自身でご判断下さいよう、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おります。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することはできません。