



وضع ارزهای عمده و نرخ های بهره

در هفته منتهی به اول ژانویه ۲۰۱۰ در بازار نیویورک در مقایسه با هفته گذشته دلار در مقابل اکثر ارزهای عمده بجز نیو تضعیف شد. در طول هفته، حجم اندک معاملات، آمار و اطلاعات مثبت اقتصادی در مورد ایالات متحده، نگرانی در مورد وضعیت اقتصادی اروپا و ژاپن و معاملات مربوط به تنظیمات پرتفوی ارزی سرمایه گذاران از مهمترین عوامل مؤثر تأثیرگذار بر وضع ارزهای عمده بودند. روز دوشنبه ۲۸ دسامبر دلار در مقابل یورو و نیو تقویت شد. نگرانی های بجا وجود آمده در مورد دورنمای اقتصاد اروپا پس از تزلزل رتبه اعتباری کشور یونان، خوش بینی های موجود در مورد آینده اقتصاد آمریکا و تقویت بازدهی اوراق خزانه داری ایالات متحده که وابستگی زیادی با نرخ برابری دلار و نیو دارد، از مهمترین عوامل تقویت دلار در این روز بودند. حجم معاملات به علت تعطیلی بسیاری از بازارها در اروپا و ژاپن اندک بود. گمانه زنی در مورد عاقبت دلار در سال میلادی بعد و ارزیابی مثبت دولت دلار در روزهای آینده نیز یکی از عوامل تقویت دلار در این روز بود. روز دوشنبه دلار در مقابل نیو ۰۵ درصد تقویت شد و شاخص ICE Futures به بهترین عملکرد از ماه فوریه تاکنون دست یافت. روز سه شنبه نیز دلار در مقابل اکثر ارزهای عمده تقویت شد. خریدهای مربوط به تنظیم پرتفوی سرمایه گذاران در افزایش شاخص اعتماد مصرف کنندگان از عوامل تقویت دلار در این روز بودند. در این روز یورو در مقابل دلار ۰۲ درصد تضعیف شد و دلار در مقابل نیو ۰۵ درصد تقویت گردید. شاخص دلاری ICE Futures نیز که معیار اندازه گیری دلار در مقابل ۱۶ ارز عمده می باشد، ۰۳ درصد تقویت گردید. دلار استرالیا و دلار نیوزیلند در مقابل دلار آمریکا به ترتیب ۰۸ و ۱۴ درصد تضعیف شدند. حجم معاملات در این روز همچنان اندک بود. روز چهارشنبه ۳۰ دسامبر دلار در مقابل اکثر ارزهای عمده تقویت شد. خریدهای پایان سال و گزارش های در مورد اقتصاد ایالات متحده که حاکی از پابرجایی آمریکا در مسیر بهبود بودند، حجم از سه ماه گذشته در مقابل نیو در این روز بود که باعث شد نرخ برابری دلار در مقابل نیو به بالاترین سطح سه ماهه برسد. گزارشات حاکی از افزایش بیش از انتظار فعالیت تجاری منطقه Midwest ایالات متحده در ماه دسامبر بودند. نقدیگی بازار در این روز کم بود و بازارهای ژاپن روزهای پنجشنبه و جمعه تعطیل بوده است. بازارهای اروپا و آمریکا نیز به مناسبت سال نو میلادی در روز جمعه تعطیل بوده است. گزارش وضعیت کاری ماه دسامبر در ۸ ژانویه منتشر می شود و بعضی از اقتصاد دانان پیش بینی می کنند که پس از کم شدن میزان کاهش فرصت های شغلی به ۱۱۰۰۰ در ماه نوامبر، اطلاعات حاکی از برگشت به وضعیت سه ماهه اول می باشد. دلار در مقابل نیو ۰۵ درصد افزایش، نسبت به روز قبل به بالاترین سطح از ۸ سپتامبر تاکنون رسید. نگرانی در مورد سلامت مالی ژاپن نیز بر نرخ نیو تأثیر گذارنده زیرا موسسه رتبه بندی استاندارد آند پوز اعلام نمود که اگر سیاست های در پیش گرفته شده شکست بخورد امکان کاهش امتیاز بدهی کشوری ژاپن وجود دارد. با افزایش نرخ برابری دلار در مقابل نیو، دلار طی روز چهارشنبه، دلار طی ماه دسامبر ۷۱ درصد در مقابل نیو تقویت شده است و بدین ترتیب بهترین عملکرد ماعانه از ماه فوریه تاکنون را داشته است. یورو در این روز در مقابل دلار ۰۲ درصد تضعیف شد. در روزهای کاری قبل نگرانی های موجود در مورد اینکه بریتانیا چگونه می تواند سری مالی گسترده خود را تأمین نماید، باعث سقوط استرلینگ به پایین ترین سطح ۲۱/۵ ماهه در مقابل دلار شده بود اما در این روز نهایتاً تیره استرلینگ ۱ درصد تقویت شد. تحلیل گران معتقدند جریان های ارزی مربوط به تنظیمات آخر سال و همچنین حجم اندک معاملات سبب تقویت لیره گردید است. شاخص دلاری ICE Futures یک درصد تقویت شد. این شاخص در طول ماه ۲/۲ درصد تقویت شده که بدین ترتیب ماه دسامبر بهترین ماه برای این شاخص از ماه فوریه تاکنون بوده است. روز پنجشنبه در معاملات اندک تعطیلات دلار به بالاترین سطح در بیش از سه ماه گذشته در مقابل نیو دست یافت. اطلاعات منتشره در این روز حاکی از کاهش دادخواست های بیکاری به پایین ترین سطح در نیمه سال ۲۰۰۸ تاکنون بود که باعث افزایش امیدواری در مورد بهبود اقتصادی گردید. دلار همچنین از خریدهای پایان سال به منظور تنظیم پرتفوی ارزی سرمایه گذاران سود برد. گرچه در ماه دسامبر شاخص دلاری ICE Futures ۴ درصد تقویت شده اما در کل سال ۴/۱ درصد افت داشته است. گزارشات روز پنجشنبه حاکی از کمتر شدن دادخواست های بیکاری در آخرین هفته از هر زمان دیگری در ۱۷ ماه گذشته بود که باعث شد نرخ های اوراق خزانه داری ۱۰ ساله در بالاترین سطح روزی به ۳/۹۲ درصد برسد که به بالاترین سطح سال که ۳/۹۵ درصد بوده و در ماه اوت حاصل شد، نزدیک می باشد. نرخ همبستگی نرخ دلار و نیو و بازدهی اوراق خزانه ۱۰ ساله در روز پنجشنبه به ۹۴ درصد رسید که بالاترین نرخ در سال می باشد و بالا رفتن نرخ بازدهی اوراق در این روز باعث شد دلار در مقابل نیو ۰۶ درصد افزایش داشته باشد. یورو در مقابل دلار در مقایسه با روز قبل تغییرات اندکی داشت اما یورو در طول سال ۲/۵ درصد در مقابل دلار تقویت شده است گرچه در طول ماه دسامبر یورو در مقابل دلار ۴/۴ درصد تضعیف شد. استرلینگ در روز پنجشنبه ۰/۶ درصد در مقابل دلار تقویت شد. در طول سال، استرلینگ در مقابل دلار ۱/۶ درصد تقویت شده است. در بیشتر ايام سال ۲۰۰۹ دلار شدیداً تضعیف شد زیرا سرمایه گذاران بر این باور بودند که بهبود اقتصاد آمریکا در مقایسه با سایر کشورها به کندي انجام می شود و فدرال رزرو نیز نرخ های بهره را برای آزاد کردن مازاد دلار تقویت نمود. با اعلامات اقتصادی بهتر از انتظار ماه دسامبر بود که وضعیت دلار تقویت کرد و معامله گران تقویت دلار را شاهد شدند. هفته آینده سرمایه گذاران اطلاعات ماهانه ایالات متحده که در روز جمعه منتشر می شود را دریافت خواهند کرد و چگونگی وضعیت بهبود اقتصادی آمریکا بر وضعیت دلار تأثیر خواهد گذارد.

بورس فلزات قیمتی

در هفته گذشته طلا در بازار فلزات قیمتی لندن و نیویورک عمدتاً مثبت تأثیر نوسانات بازار سهام و نفت خام، تقویت ارزش دلار در مقابل دیگر اسعار عمده مخصوصاً یورو و نیو، انتشار ارقام و گزارشات اقتصادی، رکود معاملات در تعطیلات سال نو و برخی عوامل دیگر قرار داشت. بطوریکه در دوره مذکور میانگین بهای هر اونس طلا در بازار های مذکور به ترتیب با ۰۵۰، درصد افزایش و ۰۳/۵، درصد کاهش به سطوح ۱۹۹۶/۸۴ و ۱۹۹۱/۳۳ دلار رسید. روز دوشنبه بهای طلا در بازار فلزات قیمتی تحت تأثیر خوش بینی ها نسبت به بهبود وضعیت رشد اقتصادی آمریکا و علیرغم افزایش ارزش دلار با اندکی افزایش یورو و بود. سودگاران بازار طلا که پیشتر روند قیمت طلا را صعودی پیش بینی می کردند، اکنون معتقدند با روند افزایش ارزش دلار، پس از تعطیلات سال نو، قیمت طلا کاهش خواهد یافت. روز سه شنبه معاملات طلا در بازار نیویورک تحت تأثیر تعطیلات پایان سال عید کریسمس یا رکود روسیه بود، نوسانات بازار قیمت نفت خام و سهام سبب کاهش اندکی در بازار معاملات شمش طلا گردید. به نظر می رسد که با جهش قیمت نفت خام و طلا در روزهای آینده، بازار طلا نیز افزایش خواهد یافت. روز چهارشنبه بهای طلا در بازار تحت تأثیر افزایش قیمت نفت خام و سهام و تقویت ارزش دلار با دو دلار کاهش به پایین ترین سطح خود یعنی کمتر از ۱۱۰۰ دلار در هر اونس طی هفته گذشته رسید. در این روز روند شدید ارزش دلار در مقابل یورو پس از انتشار اخبار اقتصادی بهتر از انتظار آمریکا، روتق گرفتن خریدهای دلاری در بازار خرده فروشی، قیمت این فلز گرانبها را با نوسان رو به رو ساخت. روز پنجشنبه بهای طلا در بازار فلزات قیمتی نیویورک و لندن تحت تأثیر نوسانات بازار سهام و نفت خام، انتشار ارقام اقتصادی بهتر از انتظار کاهش نرخ بیکاری در سه ماهه آخر سال و دیگری عوامل افزایش تقویت طلا داشته باشد. یورو در مقابل دلار در مقایسه با روز قبل تغییرات اندکی داشت اما یورو در طول سال ۲/۵ درصد در مقابل دلار تقویت شده است گرچه در طول ماه دسامبر یورو در مقابل دلار ۴/۴ درصد تضعیف شد. استرلینگ در روز پنجشنبه ۰/۶ درصد در مقابل دلار تقویت شد. در طول سال، استرلینگ در مقابل دلار ۱/۶ درصد تقویت شده است. در بیشتر ايام سال ۲۰۰۹ دلار شدیداً تضعیف شد زیرا سرمایه گذاران بر این باور بودند که بهبود اقتصاد آمریکا در مقایسه با سایر کشورها به کندي انجام می شود و فدرال رزرو نیز نرخ های بهره را برای آزاد کردن مازاد دلار تقویت نمود. با اعلامات اقتصادی بهتر از انتظار ماه دسامبر بود که وضعیت دلار تقویت کرد و معامله گران تقویت دلار را شاهد شدند. هفته آینده سرمایه گذاران اطلاعات ماهانه ایالات متحده که در روز جمعه منتشر می شود را دریافت خواهند کرد و چگونگی وضعیت بهبود اقتصادی آمریکا بر وضعیت دلار تأثیر خواهد گذارد.

بورس نفت خام

در هفته گذشته بهای نفت خام در بازارهای جهانی تحت تأثیر سرد شدن دمای هوا و تأثیر آن در افزایش بهای نفت حرارتی در معاملات آتی این ماده و همچنین اخبار موجود مبنی بر تداوم خوش بینی ها نسبت به روند بهبود وضعیت اقتصادی، کاهش در موجودی انبار نفت خام و انبار نفت حرارتی و دیزل ایالات متحده و برخی موارد دیگر قرار داشت. بطوریکه در دوره مذکور میانگین بهای هر بشکه نفت خام پامپ آمریکا و نفت خام برنت انگلیس به ترتیب با ۴/۴ و ۴/۲۶ درصد افزایش به سطوح ۷۸۹/۰۷ و ۷۷۷/۳۳ دلار رسید. روزهای دوشنبه و سه شنبه بهای نفت خام در بازارهای جهانی تحت تأثیر سرد شدن دمای هوا و تأثیر آن در افزایش بهای نفت حرارتی در معاملات آتی این ماده و همچنین اخبار موجود مبنی بر تداوم خوش بینی ها نسبت به روند بهبود وضعیت اقتصادی و نیز احتمال کاهش موجودی انبار نفت خام و انبار نفت حرارتی و دیزل ایالات متحده افزایش یافت. روز چهارشنبه بهای نفت خام در بازارهای جهانی در یک روز کاری یونسون بواسطه انتشار اطلاعات اقتصادی مندرج در گزارش هفتگی اداره کل اطلاعات انرژی آمریکا که بیانگر کاهش موجودی انبار نفت خام و دیگر محصولات پالایشگاهی این کشور بود و همچنین سرد شدن هوا، افزایش یافت. لازم به ذکر است که سرد شدن هوا در آمریکا و همچنین بروز ناآرامیها در برخی از کشورهای عضو اوپک نظیر نیجریه نیز از عوامل مؤثر بر افزایش بهای نفت خام در این روز بود، گرچه تقویت ارزش دلار به کاهش روند صعودی افزایش بهای نفت خام در معاملات آتی این روز نیز کمک نمود. کاهش موجودی انبار بنزین نیز به افزایش بهای بنزین در معاملات آتی این ماده کمک نمود. Tom Gillian تحلیل گر مؤسسه BNP Paribas Commodity Futures اظهار داشت: اطلاعات منتشره مربوط به موجودی انبار نفت خام دولتی آمریکا در رسای انتظارات موجود در بازار و برخلاف گزارش منتشره API بود. روز چهارشنبه گزارش هفتگی اداره کل اطلاعات انرژی آمریکا -بازوی اطلاع رسائی وزارت انرژی این کشور- منتشر شد. طبق گزارش مذکور انبار نفت خام، انبار نفت حرارتی و دیزل و انبار بنزین در هفته منتهی به ۲۵ دسامبر نسبت به هفته ما قبل به ترتیب با ۱/۵ و ۰/۳ و ۱/۵ میلیون بشکه کاهش به سطوح ۳۳۶/۰۳ و ۱۵۹/۳ و ۲۱۶/۰ میلیون بشکه رسیدند. لازم به یادآوری است که روز سه شنبه مؤسسه American Petroleum Institute اعلام نموده بود که موجودی انبار نفت خام افزایشی به میزان ۱/۷ میلیون بشکه و موجودیهای انبار نفت حرارتی و دیزل و انبار بنزین کاهش هایی به میزان ۳/۵ و ۱/۴ میلیون بشکه را نشان خواهند داد. همچنین تنظیمات پرتفوی های قبلی بعمل آمده از سوی خبرگزاری رویترز از تحلیل گران اقتصادی انتظار می رفت که موجودی انبار نفت خام و انبار نفت حرارتی و دیزل و انبار نفت خام هایی به میزان ۲/۰ و ۱/۴ و ۲/۵ میلیون بشکه را نشان دهد. Gene McGillian تحلیل گر مؤسسه Tradition Energy اظهار نمود: کاهش حجم معاملات تا حدودی باعث افزایش قیمت نفت حرارتی بازار انرژی شده است. احتمالاً معامله گران تمایل دارند که بهای نفت خام حدود بشکه ۸۰ دلار را نیز آزمایش کنند و ببینند که آیا روند صعودی می تواند تداوم داشته باشد. همچنین طبق اظهار نظر مؤسسه Meteorolix انتظار می رود که دمای هوا در شمال شرق آمریکا در روز چهارشنبه به کمتر از میانگین میزان نرمال برسد. روز پنجشنبه بهای نفت خام در بازارهای جهانی تحت تأثیر انقباض قراردادهای محموله های نفتی ماه ژانویه و تضعیف ارزش دلار برای همتین بار متوالی افزایش یافت. لازم به ذکر است که قراردادهای محموله های نفتی ماه ژانویه نیز در روز چهارشنبه منتهی شدند. روز جمعه نیز بازار معاملات نفتی نیویورک و لندن بواسطه آغاز سال نو میلادی تعطیل بود.

قیمت فروش هر تن انواع فلزات غیر آهنی در بورس لندن (دلار)						
تاریخ	نوع فلز	مس مفتول	آلومینیوم	روی	نیکل	سرب
جمعه اول ژانویه ۲۰۱۰		۷۳۴۶/۰	۲۲۰۸/۰	۲۵۷۰/۰	۱۸۴۸۰	۲۳۹۵/۰
پنجشنبه ۳۱ دسامبر ۲۰۰۹		۷۳۴۶/۰	۲۲۰۸/۰	۲۵۷۰/۰	۱۸۴۸۰	۲۳۹۵/۰
چهارشنبه ۳۰ دسامبر ۲۰۰۹		۷۲۹۵/۰	۲۲۳۷/۰	۲۵۴۸/۰	۱۸۸۵۵	۲۳۹۷/۰

نرخ SDR، ارزهای عمده، فلزات قیمتی، نفت خام و بهره بین بانکی						
نرخ سپرده	چهارشنبه ۳۰ دسامبر ۲۰۰۹		پنجشنبه ۳۱ دسامبر ۲۰۰۹		جمعه اول ژانویه ۲۰۱۰	
	لندن	نیویورک	لندن	نیویورک	لندن	نیویورک
حق برداشت مخصوص*	--	۱/۵۶۱۹۹	--	۱/۵۶۷۶۹	--	--
یورو*	۱/۴۳۳۴	۱/۴۳۴۲	۱/۴۴۰۷	۱/۴۳۲۵	تعطیل	۱/۴۳۲۶
لیره انگلیس*	۱/۵۸۵۵	۱/۶۰۶۷	۱/۶۲۳۰	۱/۶۱۶۱	تعطیل	۱/۶۱۷۱
فرانک سوئیس	۱/۰۳۸۲	۱/۰۳۶۵	۱/۰۲۹۴	۱/۰۳۵۵	تعطیل	۱/۰۳۴۸
ین ژاپن	۹۲/۲۵	۹۲/۴۵	۹۲/۳۷	۹۲/۹۲	تعطیل	۹۳/۰۳
بهره دلار	--	--	--	--	--	--
طلا	۱۰۸۷/۵۰	۱۰۸۹/۴۵	۱۰۸۷/۵۰	۱۰۹۶/۲۰	تعطیل	تعطیل
نقره	۱۶/۹۲	۱۶/۷۶	۱۶/۹۲	۱۶/۸۷	تعطیل	تعطیل
پلاتین	۱۴۶۳/۵۰	۱۴۵۴/۰۰	۱۴۵۹/۵۰	۱۴۶۶/۵۰	تعطیل	تعطیل
نفت خام	۷۸/۰۳**	۷۹/۲۸***	۷۷/۹۳**	۷۹/۳۶***	**تعطیل	***تعطیل
سبد نفت اوپک		۷۶/۱۹			--	--

* هر واحد به دلار آمریکا

** نفت خام برنت

*** نفت خام پایه آمریکا

**** نرخ بهره هفتگی

