

COVID19-impact pe piețele financiare

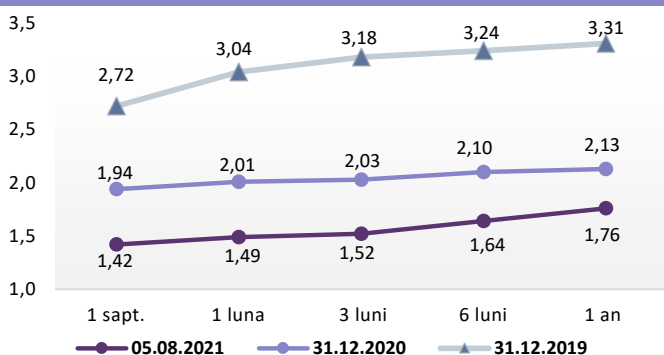
• Agerpres: Comisia Europeană a transmis că decizia privind administrarea unei a treia doze de vaccin va aparține fiecărui stat în parte. „Opțiunea asupra administrării unei doze de consolidare revine statelor membre. Ca întotdeauna, încurajăm deciziile bazate pe știință, în linie cu consiliul Agenției Europene a Medicamentului (EMA)”, a declarat la o conferință de presă Arianna Podesta, purtătoare de cuvânt a Comisiei Europene. Pe de altă parte, ea a amintit comunicatul comun pe care EMA și Centrul European pentru Prevenirea și Controlul Bolilor (ECDC) l-au publicat miercuri, în care se menționează că vaccinarea cu schema completă din prezent - două doze de vaccin Pfizer, Moderna ori AstraZeneca sau o doză Johnson & Johnson - este esențială pentru protejarea în fața efectelor cele mai grave ale infectării cu coronavirusul SARS-CoV-2, inclusiv infectarea cu varianta Delta. Franța și Germania au anunțat deja că încep să pregătească administrarea din septembrie a celei de-a treia doze de vaccin anti-COVID-19. Precizările Comisiei Europene vin la scurt timp după apelul OMS ca statele dezvoltate să amâne vaccinarea populației cu o a treia doză până când și țările mai sărace reușesc să vaccineze cel puțin 10% din populațiile lor.

• Reuters raportează că numărul cazurilor noi de coronavirus din SUA din 05 august 2021 se află la maximum ultimelor 6 luni, depășind 100.000. Anthony Fauci a precizat că numărul de cazuri zilnice ar putea atinge 200.000 în săptămânile viitoare datorită variantei Delta.

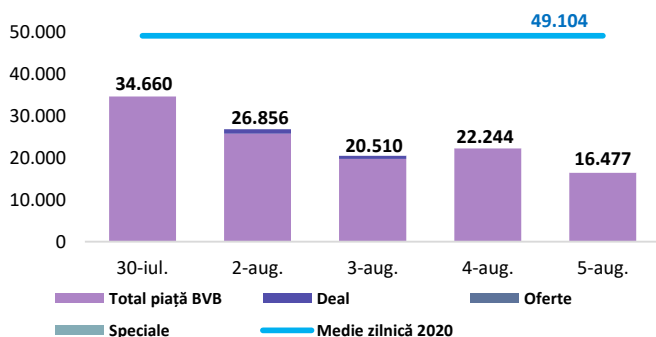
Dobânzi de politică monetară

	România	Zona Euro	Regatul Unit	Statele Unite
Valoare	1,25%	0,00%	0,1%	0% - 0,25%

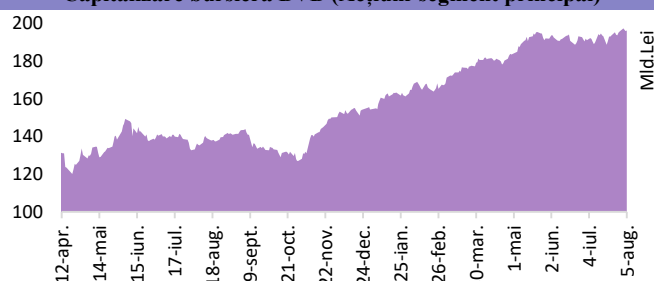
Rate interbancare- Evoluția ROBOR



Valoarea tranzacțiilor la BVB cu acțiuni (mii Lei)



Capitalizare bursieră BVB (Acțiuni-segment principal)



Știri

- EIOPA a publicat informații privind structura la termen a ratelor dobânzii fără risc relevantă pentru Solvency. Rata fără risc a dobânzii a fost calculată conform documentației tehnice publicată la 31 mai 2020.

(<https://www.eiopa.europa.eu/content/eiopa-publishes-monthly-technical-information-solvency-ii-relevant-risk-free-interest-rate-1>)

- Banca Centrală Europeană (BCE) a publicat datele consolidate pentru sistemul bancar european la 31 martie 2021. Conform datelor publicate, activele totale ale instituțiilor de credit cu sediul în Uniunea Europeană au crescut față de 31 martie 2020 cu 4,99%, de la 28,99 la 30,44 miliarde EUR. Totodată, rata creditelor neperformante a scăzut de-a lungul aceiași perioade cu 0,16%, atingând valoarea de 2,5%. La 31 martie 2021, sistemul bancar european a raportat o rată de rentabilitate a capitalurilor (ROE) de 1,87%. În structură, cele mai profitabile au fost băncile din România, Spania și Ungaria. Cele mai puțin profitabile au fost sistemul bancar din Grecia (singurul care a înregistrat pierderi), urmat de cele din Polonia și Irlanda. Datele se referă la 331 de grupuri bancare și 2.558 de bănci de sine stătătoare.

(<https://www.ecb.europa.eu/press/pr/date/2021/html/ecb.pr210805~0aea16eb0a.en.html>)

- BCE a publicat o analiză privind utilizarea Big Data, AI și ML în analiza economică. Printre sursele și tehnicile de analiză care au avut cel mai mult succes în previzionarea PIB-ului, a crizelor economice și a rezultatelor cercetărilor de conjunctură se numără:

*Analiza datelor zilnice privind tranzacțiile cu carduri de credit și debit la comercianți – folosite în previzionarea activității economice și a consumului;

*Analiza sentimentului din articolele publicate în presa economică – folosite în previzionarea fazelor ciclului economic;

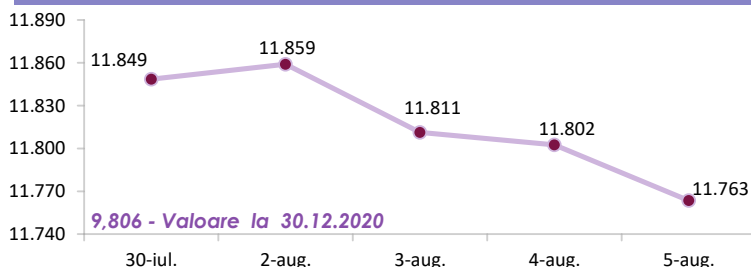
*Căutările pe Internet ale utilizatorilor – folosite în previzionarea comportamentului de consum;

*Căutările pe Internet legate de servicii disponibile – folosite în previzionarea datelor privind șomajul.

Toate aceste date au o frecvență mult mai ridicată decât datele folosite în mod tradițional pentru evaluarea mersului economiei și pot fi colectate și analizate în timp real.

(https://www.ecb.europa.eu/pub/economic-bulletin/articles/2021/html/ecb.ebart202105_02~c429c01d24.en.html)

Evoluția indicelui BET



Total turnover BVB* 14.012 Media zilnică 2020 39.068**

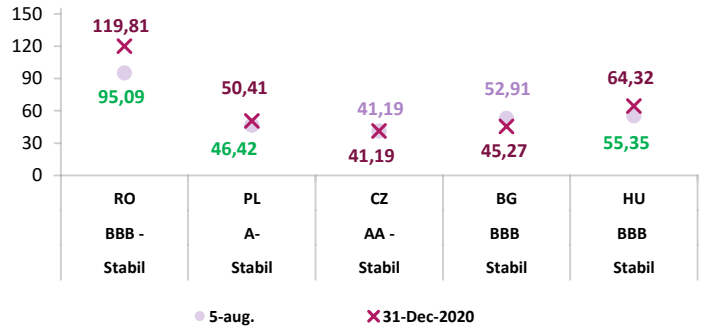
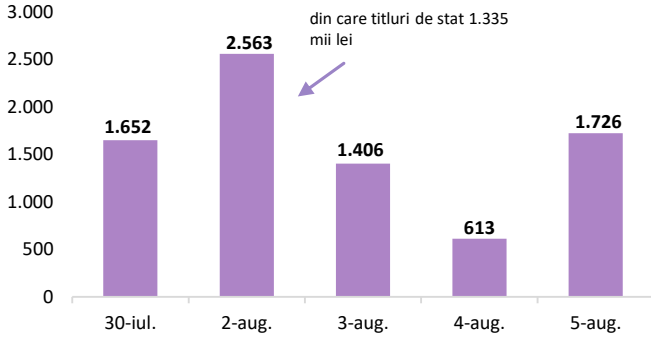
*Valoarea în mii RON pentru ziua precedentă (doar segment principal, fără SMT) ** Valoarea în mii RON pentru 2021 (numai segment principal); Media zilnică 2020:49.104

Top Creșteri/Scăderi (%) Acțiuni - ziua precedentă

Simbol	Variația prețului	Preț	Simbol	Variația prețului	Preț
TLV	1,43%	2,840	FP	-2,71%	1,794
TRP	0,32%	0,930	BRK	-0,84%	0,355
TGN	0,18%	273,000			
SNG	0,00%	31,100			
BRD	0,00%	18,000			

*Calculat pentru acțiunile cu un turnover mai mare de 250.000 RON, fără SMT

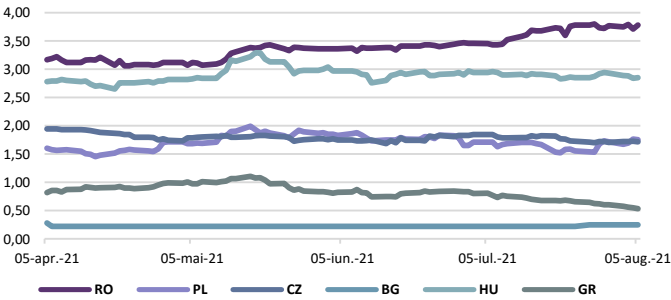
Valoarea tranzacțiilor la BVB cu obligațiuni* (mii Lei) | **Evoluția CDS (USD-5Y)**



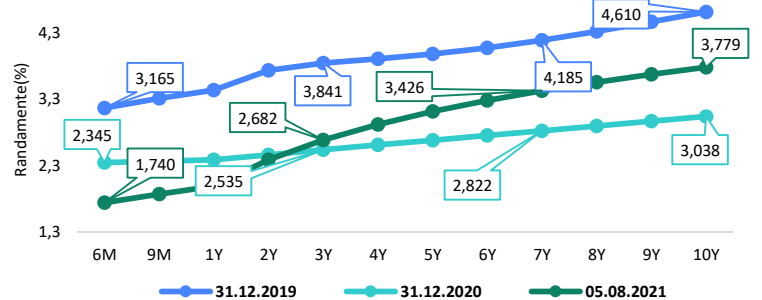
*include val. obligațiunilor tranzacționate pe segmentul principal și SMT

Sursă rating: Standard & Poor's

Randamentele titlurilor de stat (10Y, LC)



Randamentele obligațiunilor de stat în lei cu cupon zero, România



Estimări macroeconomice pentru România, anul 2021

	CE*	FMI**	CNSP*
PIB (%)	7,4	6,0	5,0
Inflație medie (%)	3,2	2,8	3,1
Sold bugetar ESA	-8,0	-7,1	-8,2
Deficit cont curent	-4,9	-5,0	-4,8

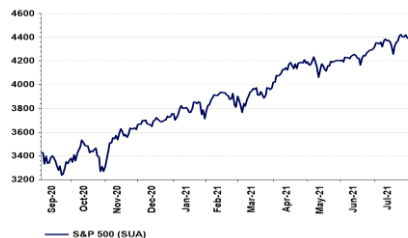
* Conform prognozei de primăvară 2021 - CNSP și prognozei de primăvară/vară 2021 CE
 ** Conform prognozei FMI din aprilie 2021

Evoluții

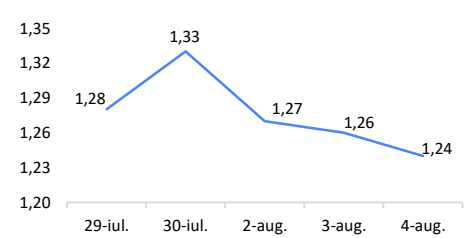
EUROSTOXX



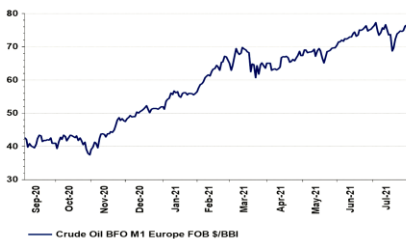
S&P 500 (SUA)



IRCC



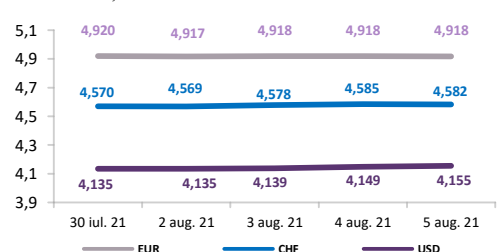
Crude Oil Brent Cur.Month FOB US\$/BBL



Gold Bullion LMB US\$/Troy Ounce



Evoluție curs valutar



Disclaimer

Acest document are un scop strict informativ, fiind realizat de Autoritatea de Supraveghere Financiară pe baza celor mai recente informații disponibile prin intermediul terminalului Datastream, BVB, BNR și ASF la data raportului. Deși toate eforturile au fost depuse pentru a asigura calitatea informațiilor furnizate, autorii nu garantează acuratețea datelor prezentate.