



AUTORITATEA
DE SUPRAVEGHERE
FINANCIARĂ

DAILY MARKET REPORT

16.10.2024



www.asfromania.ro



asf.romania



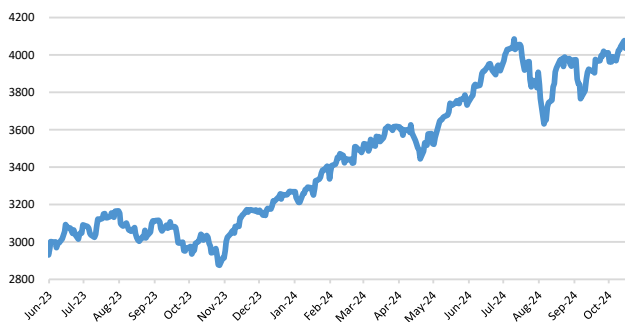
asf.romania



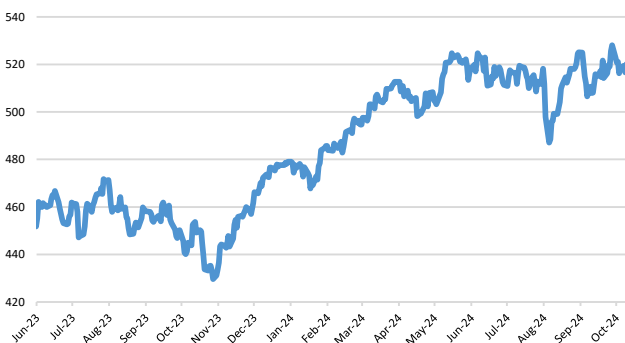
asf_romania

Context internațional

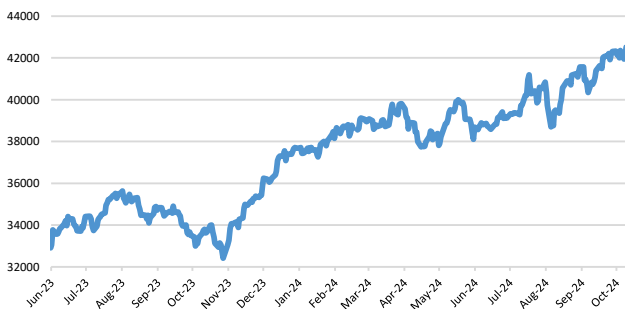
S&P GLOBAL 100 - indice de preț



STOXX EUROPE 600 - indice de preț; euro



DOW JONES INDUSTRIALS - indice de preț



BITCOIN



Sursa: Yahoo Finance

Știri

- Autoritatea Europeană pentru Valori Mobiliare și Piețe (ESMA), autoritatea de reglementare și supraveghere a piețelor

financiare din UE, Comisia Europeană și Banca Centrală Europeană au anunțat următorii pași pentru sprijinirea pregătirilor în vederea trecerii la T+1. În cea mai mare parte a ultimului deceniu, standardul global pentru decontarea instrumentelor financiare a fost ca aceasta să aibă loc în a doua zi lucrătoare după data la care titlurile respective au fost tranzacționate (T+2). Cu toate acestea, piețele internaționale de capital au început să treacă treptat la un ciclu standard de decontare a valorilor mobiliare mai scurt, și anume T+1. Această tendință a primit un impuls semnificativ în luna mai a acestui an, când America de Nord (SUA, Canada și Mexic) a trecut la decontarea T+1, ceea ce a determinat alte jurisdicții să anunțe o mișcare similară. ESMA a fost mandatată să evalueze, în strânsă cooperare cu membrii Sistemului European al Băncilor Centrale (European System of Central Banks – ESCB), oportunitatea reducerii ciclului de decontare în UE, să analizeze impactul, costurile și beneficiile și evoluțiile internaționale și să propună o foaie de parcurs detaliată pentru o decontare mai scurtă. ESMA va prezenta raportul său Consiliului și Parlamentului European în lunile următoare, însă concluziile sale preliminare sunt clare. Este urgent să se acționeze dacă UE dorește să evite prelungirea și amplificarea efectelor negative ale nealinierii cu jurisdicțiile majore la nivel internațional, având în vedere necesitatea unei uniuni europene a economiilor și investițiilor eficiente și competitive, precum și provocările trecerii la T+1 în peisajul post-comercial complex al UE. Luând în considerare nivelul ridicat de interconectare dintre piețele de capital din UE și cele din alte jurisdicții din Europa, este de dorit o abordare coordonată la nivel european, cu eforturi de a ajunge la un consens cu privire la calendarul oricărei treceri la T+1. În acest sens, serviciile Comisiei (DG FISMA), DG MIP a BCE și ESMA consideră necesară accelerarea fiecărui aspect al activității tehnice necesare pentru a pregăti terenul pentru orice trecere viitoare la T+1 în UE.

([https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/2024-10/ESMA74-2119945925-2085_EC-ECB-](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/2024-10/ESMA74-2119945925-2085_EC-ECB-ESMA_High_level_joint_statement_T_1.pdf)

[ESMA_High_level_joint_statement_T_1.pdf](#))

- În august 2024, comparativ cu iulie 2024, producția industrială ajustată sezonier a crescut cu 1,8% în zona euro și cu 1,3% în UE, conform primelor estimări ale Eurostat, biroul de statistică al Uniunii Europene. În iulie 2024, producția industrială a scăzut cu 0,5% în zona euro și cu 0,3% în UE. În august 2024, comparativ cu august 2023, producția industrială a crescut cu 0,1% în zona euro și cu 0,2% în UE. Cele mai mari creșteri anuale au fost înregistrate în Irlanda (+15,8%), Danemarca (+10,7%) și Slovenia (+7,2%). Cele mai mari scăderi au fost observate în Luxemburg (-11,7%), Estonia (-6%) și Ungaria (-4,2%).

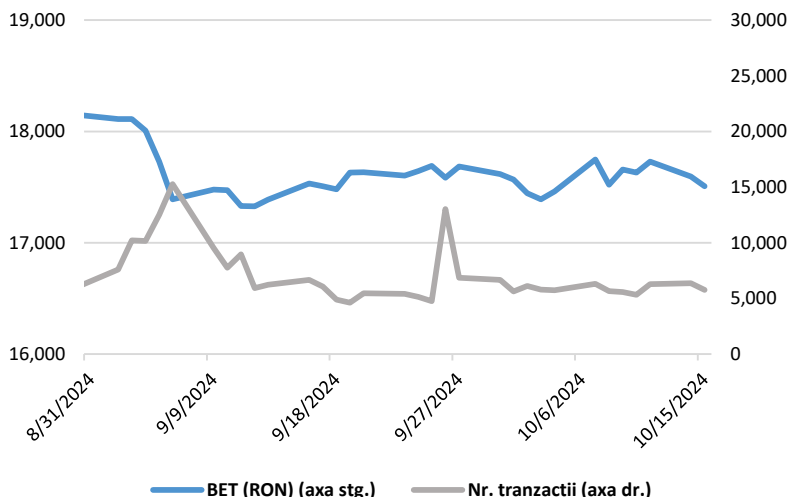
(<https://ec.europa.eu/eurostat/en/web/products-euro-indicators/w/4-15102024-ap>)

- FBI își creează propriul simbol criptografic pentru a prinde suspectii într-o presupusă schemă de fraudă. Optsprezece persoane și companii sunt acuzate de „fraudă și manipulare pe scară largă” în urma unei anchete FBI în care autoritățile și-au creat propriul jeton de criptomonedă, au declarat miercuri oficialii federali. Departamentul de Justiție al SUA a anunțat că cinci inculpați au pledat sau au fost de acord să pledeze vinovați, iar alți trei au fost arestați săptămâna aceasta în Texas, Regatul Unit și Portugalia în legătură cu o anchetă de tip „pump-and-dump”, denumită „Operation Token Mirrors”, care a confiscat, de asemenea, peste 25 de milioane de dolari în active crypto. Esența schemei a fost „manipularea pieței la cerere” pe platformele de tranzacționare a criptomonedelor, utilizând algoritmi sau roboți pentru a genera „cavadrilioane de tranzacții și miliarde de dolari de volum artificial de tranzacționare în fiecare zi”, a declarat Securities and Exchange Commission. La începutul acestui an, a declarat SEC, un presupus formator de piață numit ZM Quant a fost reținut pentru a sprijini tranzacționarea unui token numit NexFundAI. Pe hârtie, NexFundAI era o modalitate de a investi în proiecte de inteligență artificială în stadiu incipient. Angajații ZM Quant i-ar fi sfătuit pe susținătorii NexFundAI cu privire la modul de creștere artificială a prețului token-ului înainte de a vinde token-uri pentru a „încasa la vârfuri”, au declarat oficialii federali într-o acuzație. La un moment dat, în luna mai, tranzacțiile ZM Quant reprezentau peste 80 % din volumele de tranzacționare ale NexFundAI, conform SEC. Dar ZM Quant nu știa că NexFundAI nu era doar un alt jeton de criptomonedă în curs de dezvoltare care visa la o evaluare ridicată: era un instrument al agenților federali de aplicare a legii hotărâți să demonteze presupusa operațiune de pompare și abandon. NexFundAI a fost tranzacționat doar o singură zi, pe 31 mai, generând un volum artificial de tranzacționare de 4 600 de dolari, potrivit SEC. „Ceea ce am descoperit a dus la înculparea conducerii a patru companii de criptomonede și a patru „market makers” de criptomonede și a angajaților acestora, care sunt acuzați că au fost vârful de lance al unei scheme sofisticate de tranzacționare care ar fi înșelat investitori onesti cu milioane de dolari”, a declarat Jodi Cohen, agent special FBI, într-o declarație. „FBI a luat măsura fără precedent de a crea propriul său jeton de criptomonedă și propria sa companie pentru a identifica, perturba și aduce acești presupuși escroci în fața justiției.” Angajații market-makerilor Gotbit Consulting, CLS Global FZC și MyTrade MM se confruntă, de asemenea, cu acuzații, la fel ca și cei ai companiilor de criptomonede Saitama, Robu Inu, VZZN și Lillian Finance. (<https://www.ft.com/content/fca21775-f94d-4af4-b778-c1b72cc119f4>)

Context local

Evoluția indicelui BET și al numărului de tranzacții (acțiuni segment principal)

Evenimente



Sursa: BVB

Resurse de energie primară în perioada 1 ianuarie – 31 august 2024:

- În perioada 1.I-31.VIII.2024, resursele de energie primară au scăzut cu 2,6%, iar cele de energie

electrică au scăzut cu 0,9%, față de perioada 1.I-31.VIII.2023.

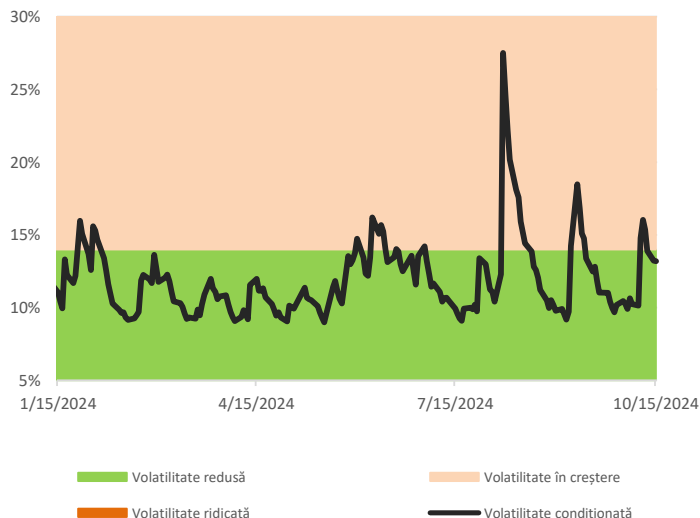
- Principalele resurse de energie primară, în perioada 1.I-31.VIII.2024, au totalizat 21350,4 mii tone

echivalent petrol¹ (tep), în scădere cu 559,5 mii tep față de perioada 1.I-31.VIII.2023.

- Producția internă a însumat 11330,2 mii tep, în scădere cu 644,7 mii tep (-5,4%) față de perioada 1.I-

31.VIII.2023, iar importul a fost de 10020,2 mii tep, în creștere cu 85,2 mii tep (+0,9%).

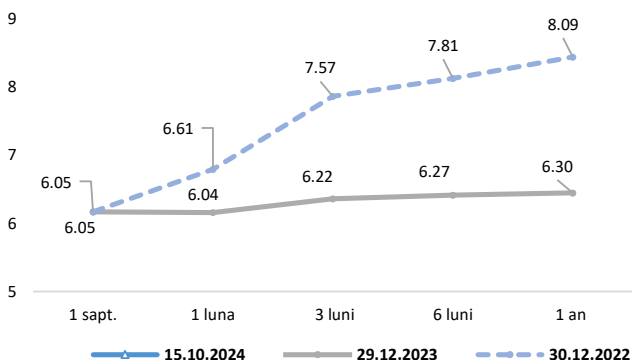
Volatilitatea condiționată a indicelui BET



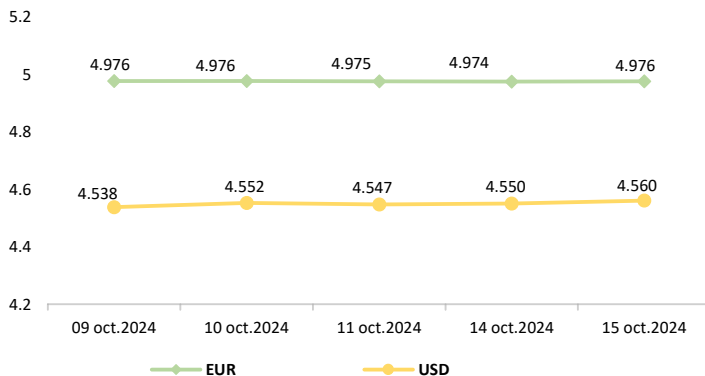
Sursa: BVB, calcule ASF

Rate interbancare- Evoluția ROBOR

Evoluție curs valutar



Sursa: BNR



Disclaimer

Autoritățile europene de supraveghere (ABE, ESMA și EIOPA – AES) avertizează consumatorii că multe criptoactive sunt extrem de riscante și speculative. Pentru majoritatea consumatorilor retail nu sunt adecvate ca investiție sau ca mijloc de plată sau de schimb. Consumatorii ar trebui să fie conștienți că nu dispun de nicio cale de atac sau protecție, întrucât criptoactivele și produsele și serviciile conexe nu intră, de regulă, sub incidența protecției existente în temeiul normelor actuale ale UE privind serviciile financiare. (<https://asf.romania.ro/ro/a/2373/informare-de-pres%C4%83-avertizare-emis%C4%83-de-autorit%C4%83C8%9Bile-de-reglementare-din-domeniul-financiar-din-ue-cu-privire-la-riscurile-criptoactivelor>) Acest document are un scop strict informativ, fiind realizat de Autoritatea de Supraveghere Financiară pe baza celor mai recente informații disponibile prin intermediul Yahoo Finance, Investing, 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.