

Il termometro dei mercati finanziari (27 Ottobre 2023)

a cura di E. Barucci e D. Marazzina

28/10/2023 10:30:12



L'iniziativa di Finriskalert.it "Il termometro dei mercati finanziari" vuole presentare un indicatore settimanale sul grado di turbolenza/tensione dei mercati finanziari, con particolare attenzione all'Italia.

Il termometro dei mercati finanziari						
27-ott-23		Legenda				
Valutazione complessiva		Calma		↑	miglioramento	
				↔	stabile	
		Tensione		↓	peggioramento	
 Mercati italiani	27-ott	20-ott	13-ott	06-ott	29-set	
Rendimento borsa italiana	-0,25	↑	-3,12	1,53	-1,53	-1,16
Volatilità implicita borsa italiana	19,87	↑	20,96	18,38	20,09	16,39
CDS principali banche 10Ysub	335,46	↑	339,64	334,85	335,95	331,02
Tasso di interesse ITA 2Y	3,93	↔	4,05	4,03	4,03	4,02
Spread ITA 10Y/2Y	0,88	↔	0,87	0,73	0,89	0,77
 Mercati europei	27-ott	20-ott	13-ott	06-ott	29-set	
Rendimento borsa europea	-0,26	↑	-2,69	-0,20	-0,72	-0,77
Volatilità implicita borsa europea	17,61	↑	18,66	16,63	17,01	15,15
Rendimento borsa ITA/Europa	0,00	↑	-0,42	1,73	-0,81	-0,39
Spread ITA/GER	1,92	↔	2,05	2,03	2,03	1,95
Spread EU/GER	0,94	↔	0,96	0,96	0,96	0,92
 Politica monetaria, cambi e altro	27-ott	20-ott	13-ott	06-ott	29-set	
Euro/Dollaro	1,06	↔	1,059	1,050	1,054	1,059
Spread US/GER 10Y	2,00	↑	2,03	1,89	1,91	1,74
Euribor 6M	4,105	↔	4,126	4,121	4,125	4,125
Prezzo Oro	1982	↔	1994	1919	1830	1857
Spread 10Y/2Y Euro Swap Curve	-0,19	↓	-0,23	-0,38	-0,21	-0,34

- Rendimento borsa italiana: rendimento settimanale dell'indice della borsa italiana FTSEMIB;
- Volatilità implicita borsa italiana: volatilità implicita calcolata considerando le opzioni at-the-money sul FTSEMIB a 3 mesi;
- Future borsa italiana: valore del future sul FTSEMIB;
- CDS principali banche 10Ysub: CDS medio delle obbligazioni subordinate a 10 anni delle principali banche italiane (Unicredit, Intesa San Paolo, MPS, Banco BPM);
- Tasso di interesse ITA 2Y: tasso di interesse costruito sulla curva dei BTP con scadenza a due anni;
- Spread ITA 10Y/2Y : differenza del tasso di interesse dei BTP a 10 anni e a 2 anni;
- Rendimento borsa europea: rendimento settimanale dell'indice delle borse europee Eurostoxx;
- Volatilità implicita borsa europea: volatilità implicita calcolata sulle opzioni at-the-money sull'indice Eurostoxx a scadenza 3 mesi;
- Rendimento borsa ITA/Europa: differenza tra il rendimento settimanale della borsa italiana e quello delle borse europee, calcolato sugli indici FTSEMIB e Eurostoxx;
- Spread ITA/GER: differenza tra i tassi di interesse italiani e tedeschi a 10 anni;
- Spread EU/GER: differenza media tra i tassi di interesse dei principali paesi europei (Francia, Belgio, Spagna, Italia, Olanda) e quelli tedeschi a 10 anni;
- Euro/dollaro: tasso di cambio euro/dollaro;
- Spread US/GER 10Y: spread tra i tassi di interesse degli

Stati Uniti e quelli tedeschi con scadenza 10 anni;

- Prezzo Oro: quotazione dell'oro (in USD)
- Euribor 6M: tasso euribor a 6 mesi.
- Spread 10Y/2Y Euro Swap Curve: differenza del tasso della curva EURO ZONE IRS 3M a 10Y e 2Y;

I colori sono assegnati in un'ottica VaR: se il valore riportato è superiore (inferiore) al quantile al 15%, il colore utilizzato è l'arancione. Se il valore riportato è superiore (inferiore) al quantile al 5% il colore utilizzato è il rosso. La banda (verso l'alto o verso il basso) viene selezionata, a seconda dell'indicatore, nella direzione dell'instabilità del mercato. I quantili vengono ricostruiti prendendo la serie storica di un anno di osservazioni: ad esempio, un valore in una casella rossa significa che appartiene al 5% dei valori meno positivi riscontrati nell'ultimo anno. Per le prime tre voci della sezione "Politica Monetaria", le bande per definire il colore sono simmetriche (valori in positivo e in negativo). I dati riportati provengono dal database Thomson Reuters. Infine, la tendenza mostra la dinamica in atto e viene rappresentata dalle frecce: ↑, ↓, ↔ indicano rispettivamente miglioramento, peggioramento, stabilità rispetto alla rilevazione precedente.

Accesso ai dati della Centrale dei Rischi

28/10/2023 10:28:50

Si può accedere ai dati della CR presentando una specifica richiesta secondo due modalità...

<https://www.bancaditalia.it/servizi-cittadino/servizi/accesso-cr/index.html?com.dotmarketing.htmlpage.language=102&dotcache=refresh>

Monetary policy decisions

28/10/2023 10:28:24

The Governing Council today decided to keep the three key ECB interest rates unchanged...

<https://www.ecb.europa.eu/press/pr/date/2023/html/ecb.mp231026~6028cea576.en.html>

Google to invest another \$2B in AI firm Anthropic: Report

28/10/2023 10:27:57

Google has already invested \$500 million as part of the deal, while the outstanding \$1.5 billion will be paid over time, according to The Wall Street Journal...

<https://cointelegraph.com/news/google-to-invest-another-two-billion-in-ai-firm-anthropic>

.....

Direttore: Emilio Barucci.

© 2021 FinRiskAlert - Tutti i diritti riservati.

Le opinioni riportate negli articoli e nei documenti del sito www.finriskalert.it sono espresse a titolo personale dagli autori e non coinvolgono in alcun modo l'ente di appartenenza.

Gli articoli e documenti pubblicati nel sito e nella newsletter FinRiskAlert hanno l'esclusiva finalità di diffondere i risultati di studi e ricerche a carattere scientifico. Essi non rappresentano in alcun modo informazioni o consulenza per investimenti, attività riservata, ai sensi delle leggi vigenti, a soggetti autorizzati.