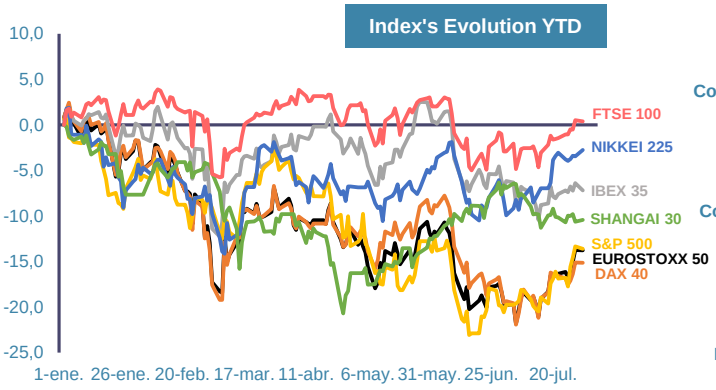
GVC INSTITUTE ECONOMIC RESEARCH

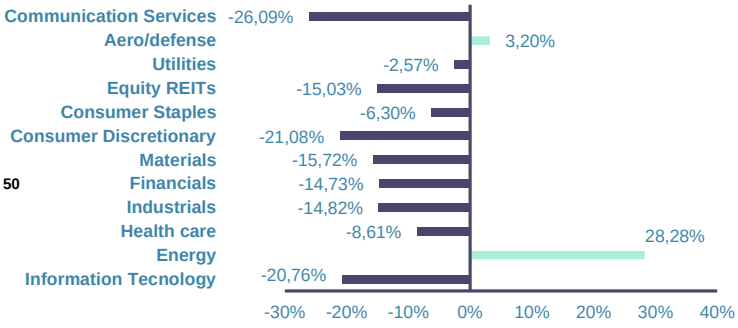
02/08/2022 8:15

DAILY REPORT

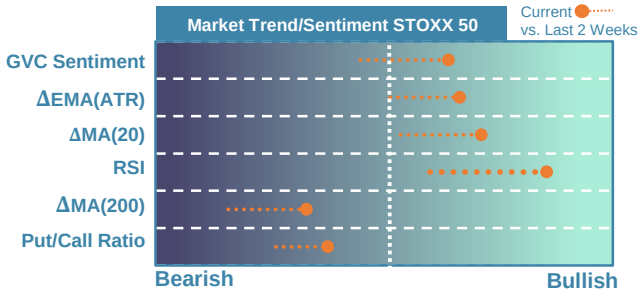
Index's Evolution YTD



MSCI World Sector Evolution YTD



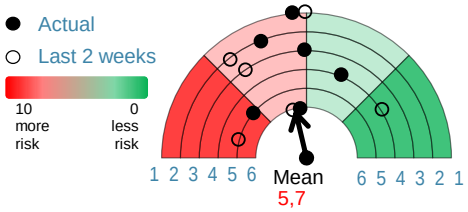
EUROPE



Market Indexs	Last	Daily Var. 22:00 PM	Future 8:15 AM	Yearly Var.
DJ Eurostoxx 50	3.706,62	-0,04%	-0,62%	-13,77%
DAX 40	13.479,63	-0,03%	-0,73%	-15,14%
CAC 40	6.436,86	-0,18%	-0,30%	-10,01%
FTSE 100	7.413,42	-0,13%	-0,51%	0,39%
IBEX 35	8.085,10	-0,87%	0,00%	-7,21%

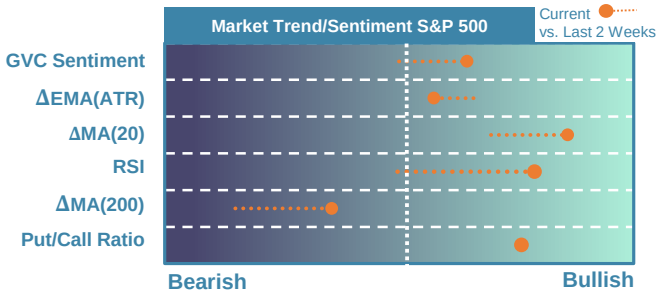
Fixed Income	Last	Daily Var.	Bip Var.	Yearly Var.
Bond Spain 10Y	1,85	-4,35%	-8,40	210,76%
Bond Germany 10Y	0,76	-7,74%	-6,40	526,26%
Bond U.K. 10Y	1,81	-2,90%	-5,40	86,01%
High yield (C.S.)	15,42	-8,53%	-143,70	338,55%

Key Risk Indicators Market



1- GVC Risk
2- VIX Eurostoxx50
3- €/$ Volatility
4- Spread 2Y-10Y
5- Risk premium (Spain/Germany)
6- Brent Volatility

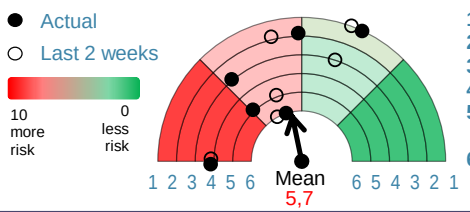
EEUU & ASIA



Market Index	Last	Daily Var. 22:00 PM	Future 8:15 AM	Yearly Var.
DJ Industrial	32.798,40	-0,14%	-0,28%	-9,74%
S&P 500	4.118,63	-0,28%	-0,39%	-13,59%
Nasdaq 100	12.940,78	-0,06%	-0,37%	-20,71%
Nikkei 225	27.594,05	0,69%	-1,54%	-2,77%
Shanghai 30	3.259,96	0,21%	-2,57%	-10,44%

Fixed Income	Last	Daily Var.	Bip Var.	Yearly Var.
Bond EEUU 10Y	2,61	-1,40%	-3,70	73,90%
Bond Japan 10Y	0,19	5,71%	1,00	164,29%
Bond China 10Y	2,74	-0,83%	-2,30	-1,69%
High yield (C.S.)	11,24	-4,87%	-57,50	155,92%

Key Risk Indicators Market



1- GVC Risk
2- VIX S&P500
3- ¥/$ Volatility
4- Spread 2Y-10Y
5- Risk premium (USA/Germany)
6- West Texas Volatility

Commodities	Last	Daily Var.	Yearly Var.
Brent Oil	100,03	-9,07%	28,61%
Gold	1.765,57	0,08%	-3,12%
CRB Index	305,78	-2,02%	23,79%
Copper (USD/LBS)	3,55	-0,78%	-20,53%

Currency	Last	Daily Var.	Yearly Var.
€/$	1,03	0,75%	-9,66%
¥/$	131,83	-1,36%	14,48%
£/€	0,84	-0,18%	-0,38%
B/$	23.064	-3,08%	-50,24%

Region/ Event	Relevance	Period	Previous	Forecast	Actual	Impact
JOLTS Job Openings	★★	Jun 2022	11,254 M	11,0382 M		-
National House Prices	★★★	Jul 2022	10,70%	11,63%	11%	Medium

gvcmacroresearch@gmail.com

GVC ECONOMIC RESEARCH INSTITUTE — CÓMO LEER EL REPORT — DAILY REPORT

Index's Evolution YTD

Gráficos en base 100.

Evolución de los principales índices. Base 31/12.

MSCI World Sector Evolution YTD

Evolución de los principales sectores del MSCI World.

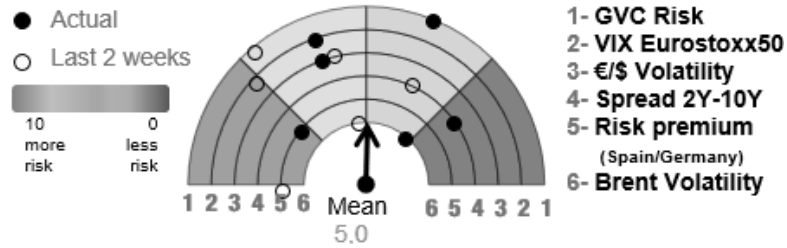
Evolución de los principales índices. Base 31/12.

Datos

Market Indexs	Last	Daily Var. 22:00 PM	Future 9:42 AM	Yearly Var.
DJ Eurostoxx 50	3.549,29	0,29%	-0,65%	-17,43%
DAX 40	13.231,82	0,35%	-0,99%	-16,70%
CAC 40	6.086,02	0,64%	-0,49%	-14,92%
FTSE 100	7.323,41	0,90%	-0,58%	-0,83%
IBEX 35	8.317,50	0,91%	-0,59%	-4,55%

Fixed Income	Last	Daily Var.	Bip Var.	Yearly Var.
Bond Spain 10Y	2,74	2,93%	7,80	360,00%
Bond Germany 10Y	1,64	6,29%	9,70	1.015,64%
Bond U.K. 10Y	2,47	3,01%	7,20	153,81%
High yield (C.S.)	8,92	2,22%	19,40	153,63%

Key Risk Indicators Market



Significado

Indicadores de tendencia y sentimiento: Bearish (tendencia bajista) o bullish (tendencia alcista). Su interpretación subyace en el posicionamiento y magnitud. Cuanto más a la derecha, más alcista será la tendencia y cuanto más a la izquierda, más bajista. Los puntos intermedios indican un mercado sin tendencia. El extremo de las líneas naranjas muestra el recorrido de dos semanas. Los indicadores muestran sensibilidad de corto y medio plazo.

Evolución de los principales índices.
- **Last:** último precio de las 22:00 del día anterior.
- **Daily Var:** Variación del día anterior.
- **Future:** La variación del precio de futuro.
- **Yearly Var:** Rentabilidad anual del índice.

Evolución de la rentabilidad de la renta fija de los principales países.
- **Bips Var:** Variación en puntos básicos diaria.
- **High Yield (C.S):** Referencia del índice de Credit Suisse AG.

Key risk indicators markets: Indicadores que muestran el riesgo de mercado en su totalidad. Color Rojo (izquierda) muestra alto riesgo de mercado. Color verde muestra bajo riesgo. La bola negra refleja el momento actual y la blanca desde hace dos semanas. Una sola bola indica que no hay cambios. "Mean" es la media, cuando más alta, más riesgo.

Comodities y Divisas: Evolución de las principales *commodities* y divisas. **Last:** último precio (22:00 del día anterior). **Daily Var:** Variación del día anterior. **Future:** La variación del precio de futuro. **Yearly Var:** Rentabilidad Anual del índice.

Commodities	Last	Daily Var.	Yearly Var.
Brent Oil	114,40	1,30%	47,08%
Gold	1.962,80	2,28%	7,70%
CRB Index	307,56	0,04%	24,51%
Copper (USD/LBS)	4,93	5,60%	10,38%

Currency	Last	Daily Var.	Yearly Var.
€/$	1,09	-1,41%	-4,05%
¥/$	114,67	-0,79%	-0,42%
£/€	0,83	-0,70%	-1,68%
B/$	42.210,00	-4,09%	-7,87%

Indicadores Macro del día, con la ratio de importancia e impacto del indicador.

Region/ Event	Relevance	Period	Previous	Forecast	Actual	Impact
GDP Final YY	★★★	Q4	6,4%	6,41%	-	-
Retail Sales YY	★★	Jan 2022	2,0%	8,64%	-	-
Non-Farm Payrolls	★★★	Feb 2022	467k	485,9k	-	-
Private Payrolls	★★	Feb 2022	444k	343,2k	-	-