

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

04.studeni 2015.

- Pad tečaja EUR/HRK
- EUR/HRK unutar 7,56 – 7,61
- Mirno na domaćem novčanom tržištu
- Američki dolar ojačao na deviznim tržištima
- Nastavak rasta indeksa u SAD, CROBEX u plusu

Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,0929	1,0931
EURCHF	1,0847	1,0850
EURGBP	0,7080	0,7090
EURJPY	132,38	132,48
GBPUSD	1,5426	1,5429
USDJPY	121,13	121,16
GOLD	1118,06	1118,83
BRENT	47,09	47,11

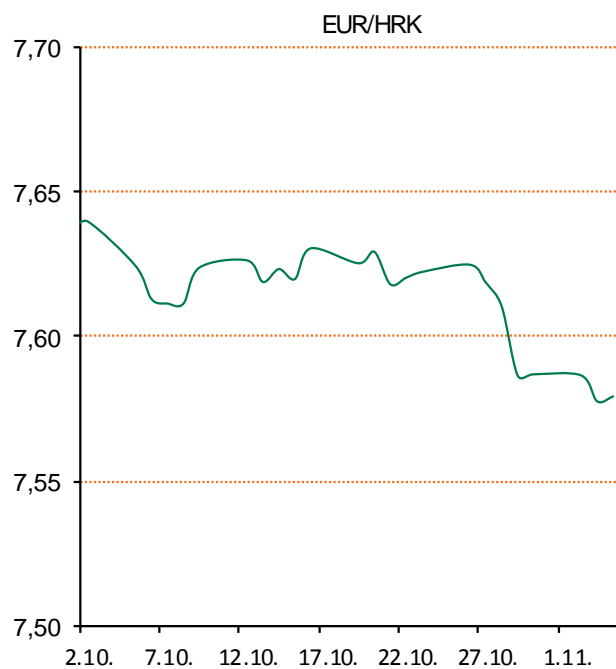
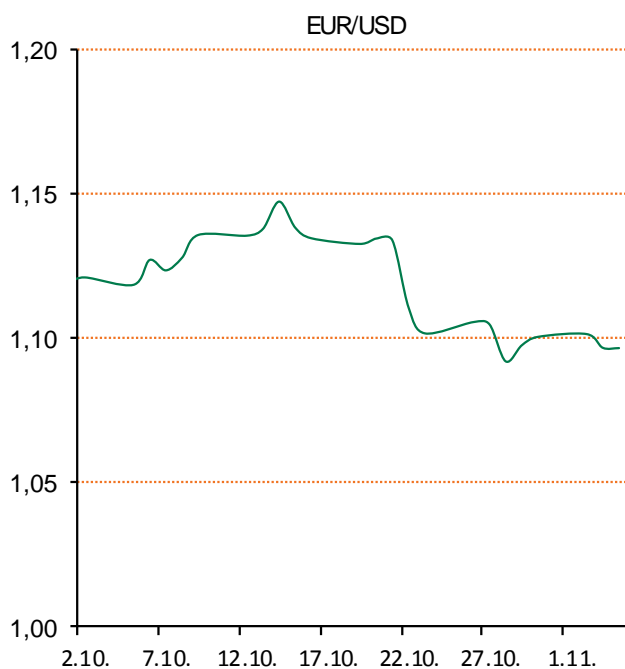
	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	1,1	2,5
T/N	1,1	2,5
1W	7	18
2W	18	38
1M	46	111
3M	192	383
6M	581	1472
12M	1226	2989

	Interest rate swap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,0513	-0,0213
2Y	-0,0373	-0,0273
3Y	0,03	0,035
4Y	0,138	0,148
5Y	0,2713	0,2763
7Y	0,554	0,564
9Y	0,806	0,836
10Y	0,919	0,949

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,5600	7,6100
USDHRK	6,9161	6,9631
CHFHRK	6,9677	7,0158
GBPHRK	10,6629	10,7486
JPYHRK	5,7065	5,7486
AUDHRK	4,9786	5,0185
CADHRK	5,2937	5,3325
NOKHRK	0,8109	0,8165
DKKHRK	1,0136	1,0203
SEKHRK	0,8073	0,8129
HUFHRK	2,4032	2,4214
PLNHRK	1,7775	1,7905
CZKHRK	0,2790	0,2812

Letargično trgovanje na domaćem deviznim tržištu nastavilo se i jučer, ujednačena ponuda i potražnja usidrla je tečaj EUR/HRK unutar uskog raspona 7,58 – 7,584 skoro cijeli dan. Ipak pred kraj radnog dana zbog veće ponude deviza na međubankarskom tržištu tečaj je skliznuo na 7,576 kuna za euro. Danas očekujemo nastavak mirnog trgovanja unutar 7,56–7,61.

Američki dolar je ojačao u odnosu na svoje konkurente i oporavio se od nedavnih gubitaka koji su zabilježeni nakon serije slabih podataka iz SAD-a. Jedinstvena europska valuta našla se pod pritiskom nakon što je broj nezaposlenih u španjolskoj porastao za 82 tisuće. Aktivnosti u građevinskom sektoru Velike Britanije pale su u listopadu s 59,90 na 58,80. U takvim okolnostima američka valuta je ojačala na 1,0935 u odnosu na euro, dok je u odnosu na funtu na razinama 1,5420. Dolar je također zabilježio pozitivne pomake u odnosu na jen i švicarski franak.



Sport: U sklopu četvrtog kola grupne faze Lige prvaka, ukrajinski Šahtar ugostio je švedski Malmö i pobijedio rezultatom 4:0, čime se bodovno poravnao sa svojim protivnikom iza Real Madrida i PSG-a u Skupini A. Hrvatski nogometaši Darijo Srna i Eduardo Alves da Silva ugradili su po jedan pogodak u Šahtarov uspjeh u Ligi prvaka.

Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamatne stope na dan				Vrijednost udjela fondova	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	0,131	-0,774	-	0,88	PBZ Novčani fond	142,9454
1W	0,15365	-0,795	-0,150	0,90	PBZ Euro novčani fond	139,0099
2W			-0,148	0,99	PBZ Dollar fond	130,9967
1M	0,19	-0,774	-0,121	1,27	PBZ Bond fond	122,9046
3M	0,3341	-0,732	-0,069	1,51	PBZ Global fond	14,4262
6M	0,55615	-0,691	0,003	1,78	PBZ Equity fond	10,4101
1Y	0,87465	-0,593	0,106	2,20	PBZ Conservative 10 fond	104,4614

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospjeća
91	HRK	0,28	100	05.03.2015	04.06.2015
182	HRK	0,40	30	27.08.2015	25.02.2015
364	HRK	1,50	1290	29.10.2015	27.10.2016
546	EUR	1,95	1225	12.02.2015	11.08.2016
91	EUR/VK	0,20	6,00	29.10.2015	28.01.2016
364	EUR/VK	0,40	8,00	29.10.2015	27.10.2016

	Kamatni swapovi		
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0,0562	-	-
2 Y	-0,0370	0,8760	-0,8030
3 Y	0,0079	1,1380	-0,7500
4 Y	0,1400	1,3540	-0,6490
5 Y	0,2690	1,5360	-0,5180
6 Y	0,4080	1,6930	-0,3720
7 Y	0,5510	1,8260	-0,2330
8 Y	0,6790	1,9350	-0,1070
9 Y	0,8140	2,0250	0,0070
10 Y	0,9180	2,1020	0,1000

	PBZ Referentne kamate na HRK				
	O/N	1W	2W	1M	3M
Bid	0	0	0	0,100	0,4
Ask	0,3	0,3	0,5	0,600	0,9

Zibor na O/N



Pregled tržišta obveznica

Obveznice Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Euro - Val. klauzula</i>						
RHMF-O-19BA	5,375%	29.11.2019	110,60	111,10	2,60	2,48
RHMF-O-203E	6,500%	05.03.2020	115,50	116,20	2,68	2,52
RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	117,00	117,70	3,62	3,51
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	114,00	114,70	3,84	3,75
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-15CA	5,250%	15.12.2015	100,30	100,60	2,15	-0,83
RHMF-O-167A	5,750%	22.07.2016	102,25	102,75	2,49	1,78
RHMF-O-172A	4,750%	08.02.2017	102,40	102,90	2,78	2,37
RHMF-O-17BA	6,250%	25.11.2017	106,50	107,00	2,95	2,70
RHMF-O-187A	5,250%	10.07.2018	105,20	106,20	3,20	2,82
RHMF-O-203A	6,750%	05.03.2020	112,40	113,40	3,62	3,36
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	102,25	103,25	4,21	4,08

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	104,18	0,56
Francuska	100,79	0,92
Austrija	103,44	0,84
Italija	99,75	1,53
Španjolska	103,95	1,72
Portugal	103,21	2,51
Češka	117,96	0,53
Grčka	71,50	7,97
Slovenija	132,73	1,67

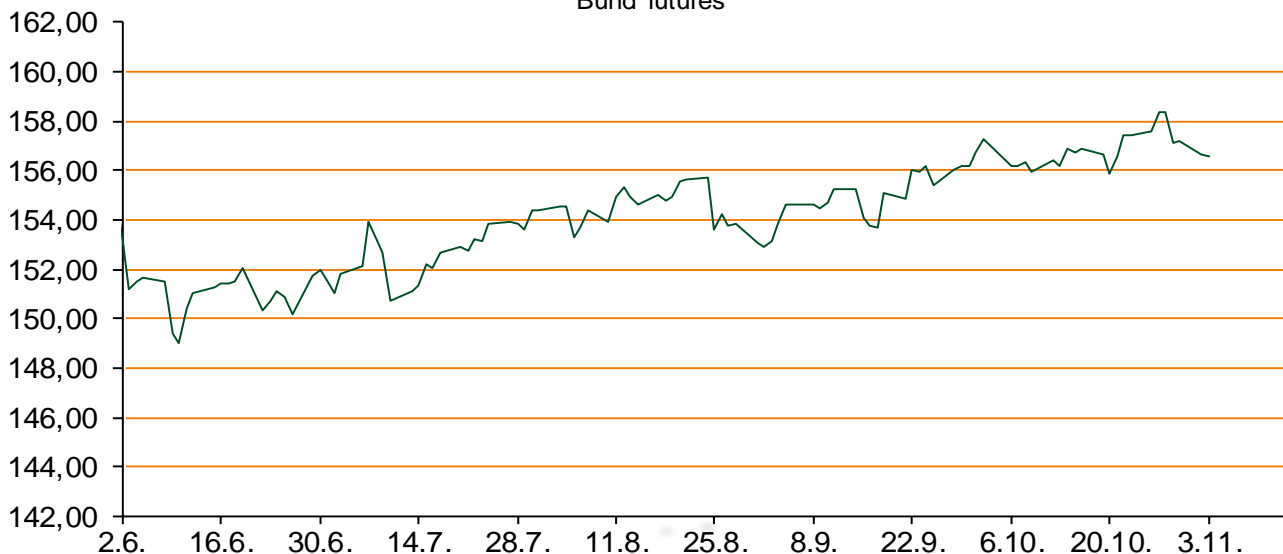
Eurobonds Rep. Hrvatske i hrvatskih kompanija

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA USD 2017	6,250%	27.04.2017	104,65	105,15	2,94	2,61
CROATIA EUR 2018	5,875%	09.07.2018	109,60	110,10	2,12	1,94
CROATIA USD 2019	6,750%	05.11.2019	108,60	109,10	4,38	4,25
CROATIA USD 2020	6,625%	14.07.2020	108,60	109,10	4,56	4,45
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	107,70	108,20	4,73	4,63
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	100,45	100,95	3,79	3,71
CROATIA USD 2023	5,5%	04.04.2023	103,00	103,50	5,01	4,93
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	106,15	106,65	5,07	5,00
CROATIA EUR 2025	3,000%	09.03.2025	91,20	91,50	4,16	4,11
<i>Hrvatske kompanije</i>						
AGROKOR 2020	9,125%	10.10.2020	107,50	108,50	7,04	6,77
AGROKOR 2019	9,875%	01.05.2019	106,90	107,90	7,58	7,26
ZG. HOLDING 2017	5,500%	10.07.2017	94,00	95,00	9,52	8,82
HEP USD	6,000%	09.11.2017	106,30	107,30	2,74	2,25
HEP USD	5,875%	23.10.2022	101,00	102,00	5,70	5,52

CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	137	233	298
Italija	34	74	102
Spain	29	63	87

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

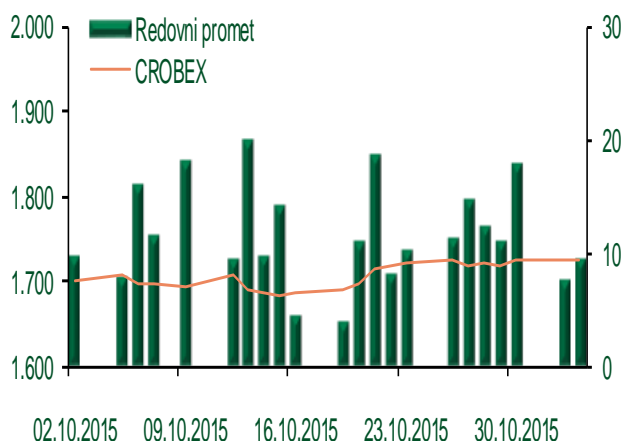
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 03.11.2015.

Ukupni promet ('000 HRK)	9.590,28
Redovni promet ('000 HRK)	9.590,28
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	25.588,23
Vrijednost CROBEX indeksa	1.725,36
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,11%
Promjena CROBEX indeksa u 2015.	-1,15%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.013,52
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,09%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2015.	0,63%

Izvor: Zagrebačka burza

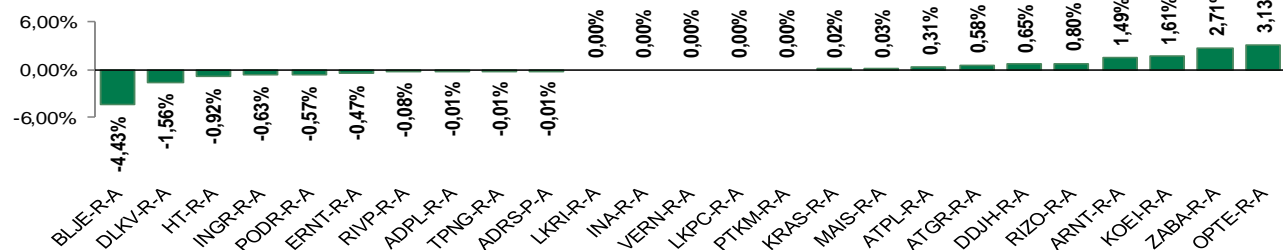
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 03.11.2015.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
TUHO-R-A	TURISTHOTEL d.d.	2.700,00	3,85%	8,87%	3.906,27	1.065,84
ADRS-P-A	Adris Grupa d.d.	372,90	-0,01%	9,68%	1.595,42	2.529,79
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	24,13	-0,08%	21,44%	944,39	3.041,04
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	144,80	-0,92%	-3,79%	376,72	11.857,46
JDGT-R-A	JADROAGENT d.d.	1.100,00	7,84%	47,74%	300,29	135,32

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 03.11.2015.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	611,32	-1,05%	-8,35%
BELEXline	1.309,24	-0,26%	-2,65%
SBI TOP	699,54	0,69%	-10,77%
SASX-10	693,18	0,64%	-3,02%
BIRS	685,80	-0,36%	-4,92%
MONEX 20	11.598,00	-0,38%	2,13%
MBI-10	1.740,56	0,00%	-5,62%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 03.11.2015.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	6383,61	+0,34%	-2,78%
DAX 30	10951,15	+0,00%	11,68%
CAC 40	4936,18	+0,41%	15,53%
DJIA	17918,15	+0,50%	0,53%
NASDAQ	5145,13	+0,35%	8,64%
S&P 500	2109,79	+0,27%	2,47%
NIKKEI 225	18926,91	+1,30%	8,46%

Izvor: Bloomberg

Kontakti

Sektor poslova Riznice	treasury@pbz.hr
Direkcija prodaje	01 4891 301
Direkcija likvidnosti	01 4891 303
Direkcija trgovanja	
-Trgovanje devizama	01 4891 302
-Trgovanje vrijednosnim papirima	01 4891 304
-Trgovanje efektivom	01 4891 305
Sektor investicijskog bankarstva	brokeri@pbz.hr
Direkcija brokerskih poslova	01 4891 331

Pravne napomene:

Ovu publikaciju izdaje PRIVREDNA BANKA ZAGREB-DIONIČKO DRUŠTVO, Zagreb, Radnička cesta 50 (dalje:PBZ) i namijenjena je klijentima Grupe PBZ. Ova publikacija je načinjena samo sa svrhom informiranja i ne može se niti na koji način smatrati ponudom ili pozivom na kupnju imovine ili prava koje se u njoj spominju. Informativni karakter ove publikacije znači da ona ne može služiti kao zamjena za vlastitu prosudbu i procjenu bilo kojeg čitatelja ili primatelja ove publikacije. Informacije, mišljenja, zaključci, prognoze i projekcije koje se ovdje iznose zasnivaju se na javno dostupnim podacima u čiju se točnost PBZ pouzda, ali istu ne može jamčiti. U skladu s navedenim, svi stavovi, mišljenja, zaključci, prognoze i projekcije izneseni u ovoj publikaciji podložni su promjenama podataka kako ih objavljuju korišteni izvori. PBZ dozvoljava daljnje korištenje podataka iz ove publikacije, uz obavezno navođenje ove publikacije kao izvora. Svaka imovina koja se spominje u ovoj publikaciji i čije se kretanje komentira može, s vremena na vrijeme, biti predmet trgovanja, odnosno zauzimanja pozicije od strane PBZ-a.