

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

07. listopada 2016.

- letargično na domaćem tržištu
- „range” trgovanja 7,48 – 7,53
- blago jačanje dolara na međunarodnim tržištima
- u SAD-u ulagači čekaju novi izvještaj o zaposlenosti
- kotacija EURUSD 1,1195
- funta skliznula naspram dolara
- cijene nafte nadomak razine od 52 dolara
- europski indeksi u laganom padu, SAD bez većih promjena

Pregled deviznog tržišta

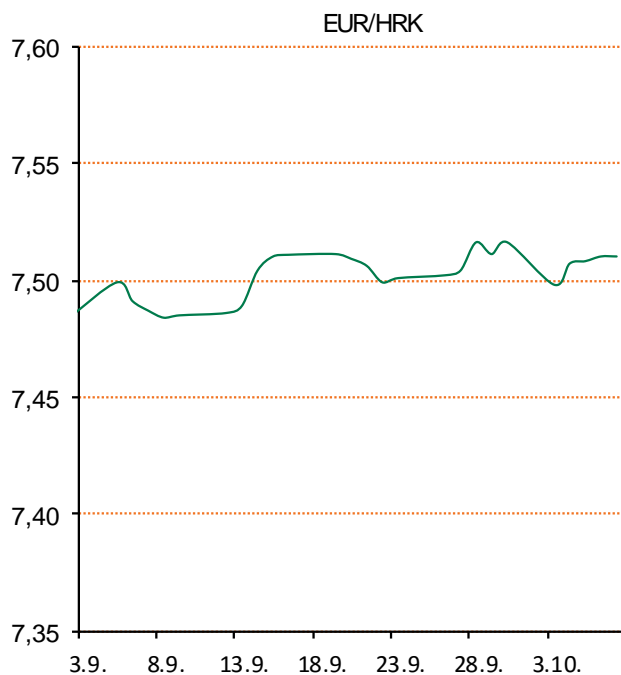
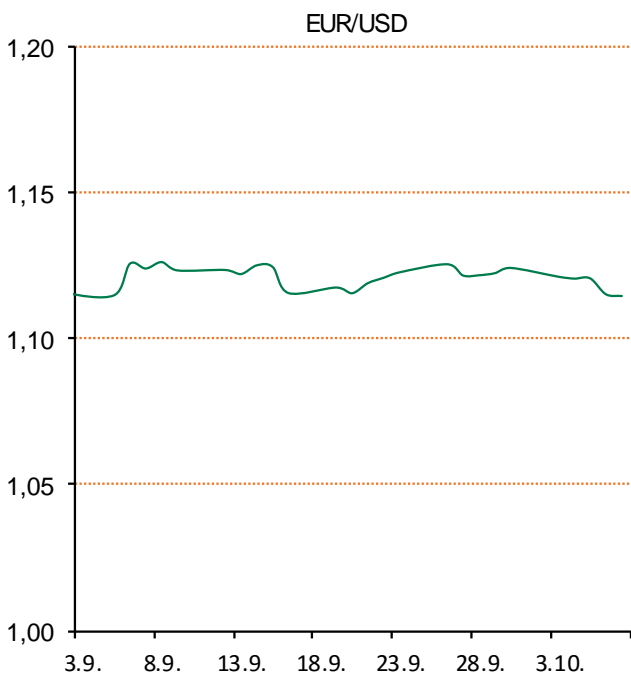
Spot rates		
	BID	ASK
EURUSD	1,1110	1,1111
EURCHF	1,0920	1,0925
EURGBP	0,8934	0,8939
EURJPY	115,40	115,45
GBPUSD	1,2433	1,2435
USDJPY	103,87	103,9
GOLD	1254,43	1254,57
BRENT	49,53	49,55

Forward points EUR/HRK		
	BID	ASK
O/N	7,4	12,8
T/N	2,5	4,3
1W	17	30
2W	34	60
1M	96	171
3M	268	507
6M	302	714
12M	683	1511

Interest rate swap EUR		
	BID	ASK
1Y	-0,22	-0,18
2Y	-0,21	-0,2
3Y	-0,212	-0,162
4Y	-0,16	-0,13
5Y	-0,095	-0,065
7Y	0,079	0,109
9Y	0,282	0,312
10Y	0,383	0,403

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4800	7,5300
USDHRK	6,7321	6,7777
CHFHRK	6,8467	6,8956
GBPHRK	8,3678	8,4285
JPYHRK	6,4790	6,5251
AUDHRK	5,0971	5,1322
CADHRK	5,0801	5,1144
NOKHRK	0,8304	0,8363
DKKHRK	1,0054	1,0122
SEKHRK	0,7769	0,7825
HUFHRK	2,4631	2,4812
PLNHRK	1,7463	1,7582
CZKHRK	0,2766	0,2789

Dobro jutro. U četvrtak je bilo letargično na domaćem tržištu. Jučerašnji dan smo otvorili s kotacijom 7,508 EURHRK, a zatvorili sa kotacijom 7,509. Ključni indeksi Zagrebačke burze su peti dan zaredom zaključili porastom. CROBEX je rastao za 0,21% na 1.969,60 boda, dok je CROBEX10 rastao 0,45%, na 1.155,26 boda. To je ujedno i najveća razina CROBEX-a od travnja 2013. godine. Ukupni redovni promet na ZSE-u iznosio je 7,6 milijuna kuna, što je za 1,7 milijuna kuna manje nego dan prije. Najlikvidnija dionica je bila od Valamar Riviera. Dolar je u četvrtak blago ojačao prema košarici valuta na međunarodnim deviznim tržištima, dok ulagači čekaju najnovije izvješće o zaposlenosti u Sjedinjenim Državama za koje se nadaju da bi moglo poduprijeti očekivanja da će američka središnja banka Fed do kraja godine podići kamatne stope. Dolar je ojačao blagih 0,1% prema euru kojim se tako trgovalo po 1,1195 dolara. Na sličnom postotnom dobitku bio je i prema jenu pa se dolarom trgovalo po 103,71 jena. Funta je u četvrtak skliznula 0,3 posto prema dolaru, na 1,2711 dolara, i drži se tako i dalje nedaleko najnižih razina u 31 godinu, na koje se spustila u srijedu. Cijene nafte stabilizirale su se u četvrtak na međunarodnim tržištima nadomak razine od 52 dolara, poduprte podatkom o neočekivano snažnom padu američkih zaliha. Na londonskom je tržištu cijena barela ostala nepromijenjena u odnosu na prethodno zatvaranje i iznosila je 51,85 dolara. Značajnijih promjena u cijeni nije bilo ni na američkom tržištu, gdje se barelom trgovalo po 49,74 dolara.



Njoki s gljivama - Na ulju popržiti luk(1 komad) i dodati gljive (500g, mogu biti šampinjoni). Dodati 2 dcl vode, pola žličice soli, malo papra, pola žličice vegete. Kuhati dok gljive malo ne omekšaju. U posebnom loncu skuhati njoke u slanoj vodi. U lonac s gljivama dodati 500 ml vrhnja za kuhanje te skuhanu njoke. Promiješati i poslužiti sa svježim peršinom.

Pregled novčanog tržišta

Opis	c		06.10.2016	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor
O/N	0,42822	-0,795	-	0,63
1W	0,45589	-0,805	-0,380	0,64
2W			-0,372	0,63
1M	0,52567	-0,796	-0,371	0,73
3M	0,86794	-0,735	-0,304	0,88
6M	1,25578	-0,646	-0,202	0,99
1Y	1,57267	-0,483	-0,064	1,30

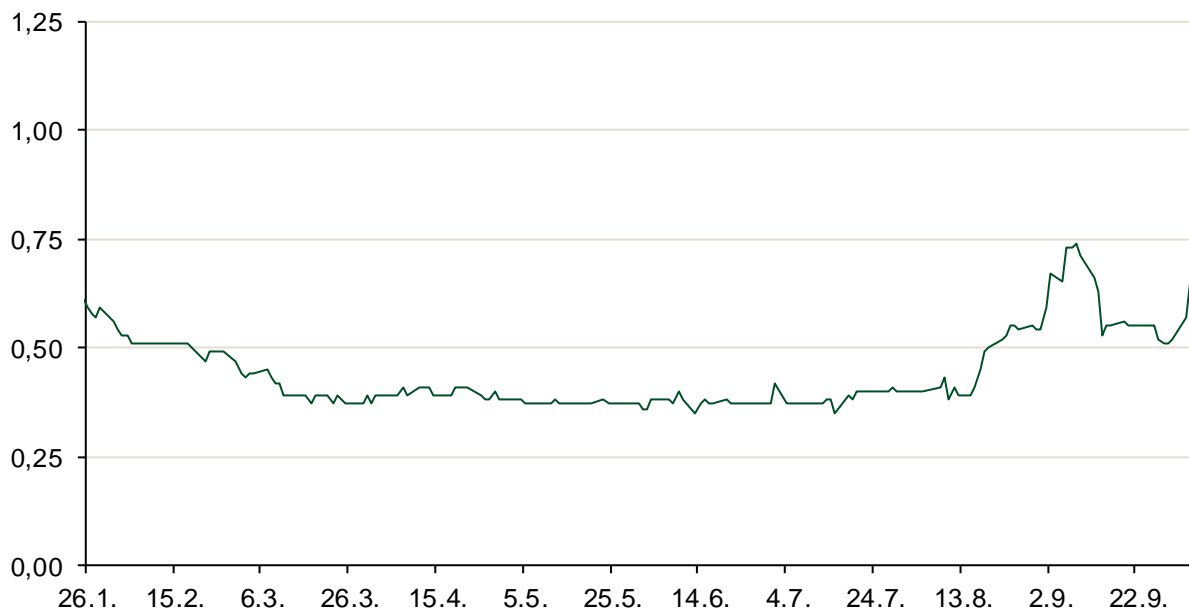
Vrijednost udjela fondova		05.10.2016
Fond		
PBZ Novčani fond		143,4226 HRK
PBZ Euro novčani		139,3309 EUR
PBZ Dollar		132,1759 USD
PBZ Short term bond		102,3769 HRK
PBZ Bond		130,6699 EUR
PBZ Conservative 10		111,3129 EUR
PBZ Flexibile 30		101,1086 EUR
PBZ Global		14,9494 EUR
PBZ Equity		11,6273 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospijeća
364	HRK	0,87	406	01.09.2016	31.08.2017
364	EUR/VK	0,24	20,00	01.09.2016	31.08.2017
455	EUR	0,70	1.500,00	11.08.2016	09.11.2017

	Kamatni sw apovi		
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0,2300	0,9870	-0,6975
2 Y	-0,2110	1,0800	-0,6640
3 Y	-0,2050	1,1520	-0,6470
4 Y	-0,1640	1,2240	-0,6110
5 Y	-0,1000	1,2940	-0,5540
6 Y	-0,0220	1,3600	-0,4860
7 Y	0,0710	1,4230	-0,4150
8 Y	0,1700	1,4820	-0,3460
9 Y	0,2700	1,5360	-0,2780
10 Y	0,3660	1,5850	-0,2080

PBZ Referente kamate					
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00
Ask	1,50	1,50	1,50	1,50	1,50
EUR	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid	0,00	0,00	0,00	0,01	0,01
Ask	0,20	0,20	0,30	0,41	0,51
USD	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid	0,40	0,50	0,70	0,90	1,00
Ask	1,00	1,10	1,30	1,50	1,60

Zibor na O/N



Pregled tržišta obveznica

Obveznice Republike Hrvatske						
Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Euro - Val. klauzula</i>						
RHMF-O-19BA	5,375%	29.11.2019	112,80	113,50	1,20	0,99
RHMF-O-203E	6,500%	05.03.2020	117,40	118,10	1,26	1,07
RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	119,90	120,60	2,75	2,63
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	118,40	119,10	3,06	2,97
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-172A	4,750%	08.02.2017	101,30	101,50	0,75	0,15
RHMF-O-17BA	6,250%	25.11.2017	105,80	106,30	1,04	0,61
RHMF-O-187A	5,250%	10.07.2018	106,50	107,00	1,47	1,19
RHMF-O-203A	6,750%	05.03.2020	115,90	116,90	1,90	1,60
RHMF-O-217A	2,750%	08.07.2021	102,50	103,50	2,19	1,97
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	110,30	111,30	3,14	3,01
RHMF-O-26CA	4,250%	14.12.2026	109,00	110,00	3,21	3,09

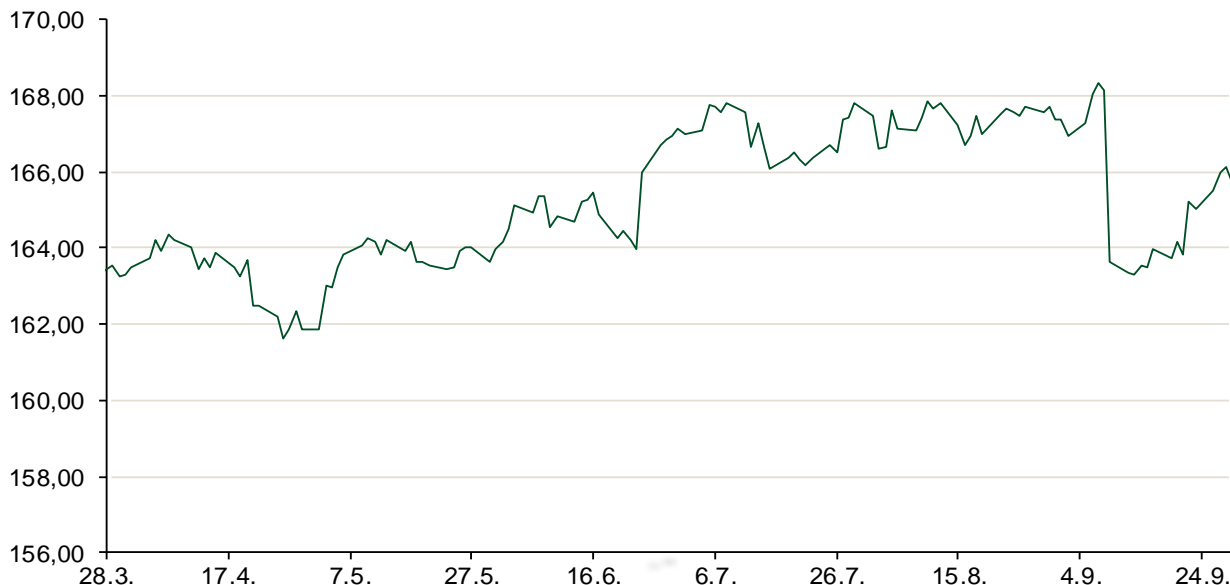
Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina		
Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	99,89	0,01
Francuska	99,41	0,31
Austrija	105,11	0,23
Italija	102,07	1,38
Španjolska	108,19	1,04
Portugal	94,49	3,55
Češka	106,60	0,31
Grčka	70,68	8,26
Slovenija	141,06	0,64

Eurobonds Rep. Hrvatske						
Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA USD 2017	6,250%	27.04.2017	102,20	102,70	2,16	1,25
CROATIA EUR 2018	5,875%	09.07.2018	109,80	110,30	0,23	-0,03
CROATIA USD 2019	6,750%	05.11.2019	110,35	110,85	3,18	3,02
CROATIA USD 2020	6,625%	14.07.2020	111,30	111,80	3,39	3,26
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	111,35	111,85	3,59	3,48
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	107,20	107,70	2,49	2,40
CROATIA USD 2023	5,5%	04.04.2023.	109,90	110,40	3,76	3,68
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	113,70	114,20	3,83	3,75
CROATIA EUR 2025	3,000%	11.03.2025	101,30	101,80	2,82	2,76

CDS Pregled			
Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	38	125	200
Italija	62	112	149
Spain	28	55	78

Hrvatske korporativne obveznice						
AGROKOR 2020	9,125%	10.10.2020	102,40	103,40	8,27	7,93
AGROKOR 2019	9,875%	01.05.2019	102,25	103,25	8,87	8,43
ZG. HOLDING 2023 HRK	3,875%	15.07.2023	100,25	101,75	3,83	3,58
HEP USD	6,000%	09.11.2017	104,90	106,40	1,41	0,06
HEP USD	5,875%	23.10.2022	108,70	110,20	4,23	3,96

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

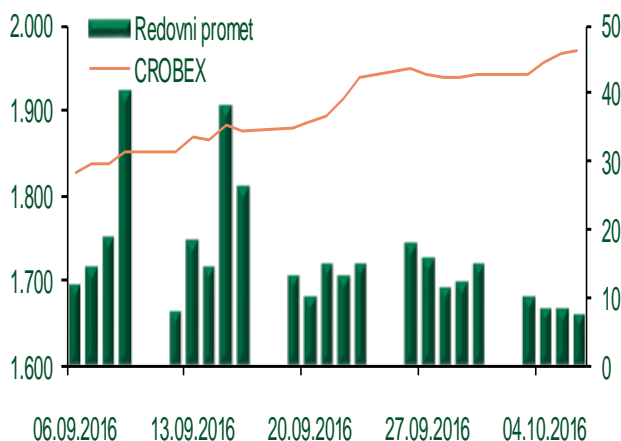
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 06.10.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	7.285,25
Redovni promet ('000 HRK)	7.285,25
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	6.480,46
Vrijednost CROBEX indeksa	1.969,60
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,21%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	16,57%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.155,26
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,45%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	16,78%

Izvor: Zagrebačka burza

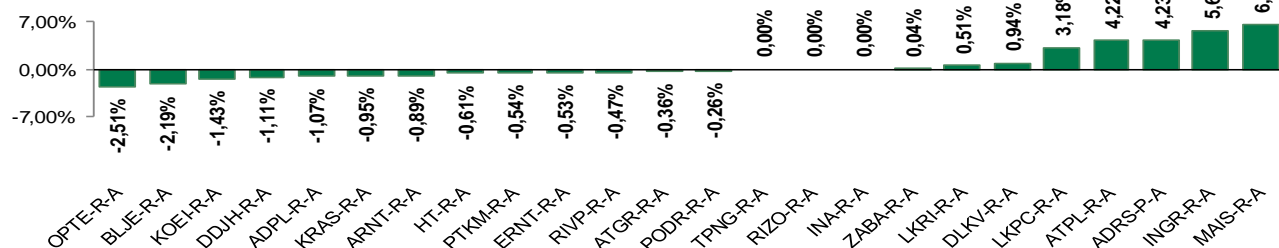
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 06.10.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	33,93	-0,47%	40,96%	924,50	4.276,11
MAIS-R-A	Maistra d.d. za hotelijerstvo i turizam	245,00	6,52%	6,57%	917,92	2.513,06
ADRS-P-A	Adris Grupa d.d.	471,10	4,23%	29,07%	790,35	3.195,99
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	165,20	-0,61%	14,40%	763,35	13.527,99
LEDO-R-A	Ledo d.d.	11.000,00	1,11%	21,76%	572,00	2.421,87

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 06.10.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	642,24	0,60%	-0,29%
BELEXline	1.456,37	0,12%	5,50%
SBI TOP	738,72	0,02%	6,12%
SASX-10	690,66	-0,11%	-1,20%
BIRS	560,82	-0,22%	-14,90%
MONEX 20	10.675,18	0,12%	-11,98%
MBI-10	1.967,30	-0,32%	7,31%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 06.10.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	6999,96	-0,47%	12,14%
DAX 30	10568,8	-0,16%	-1,62%
CAC 40	4480,1	-0,22%	-3,38%
DJIA	18268,5	-0,07%	4,84%
NASDAQ	5306,85	-0,17%	5,98%
S&P 500	2160,77	+0,05%	5,72%
NIKKEI 225	16860,09	-0,23%	-11,42%

Izvor: Bloomberg

Kontakti

Riznica i ALM

Prodaja rizničnih proizvoda
treasurysales@pbz.hr

01 4891 301

Riznica
treasury@pbz.hr

- Likvidnost 01 4891 303
- Trgovanje devizama 01 4891 302
- Trgovanje vrijednosnim papirima 01 4891 304
- Trgovanje efektivom 01 4891 305

Proizvodi korporativnog bankarstva

Brokerski poslovi
brokeri@pbz.hr

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 pouzdaje, 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.