

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

07. prosinac 2016.

- EUR/HRK unutar 7,51 – 7,56
- Održana aukcija trezorskih zapisa
- EUR/USD iznad 1,07
- Nastavak porasta svjetskih burzovnih indeksa

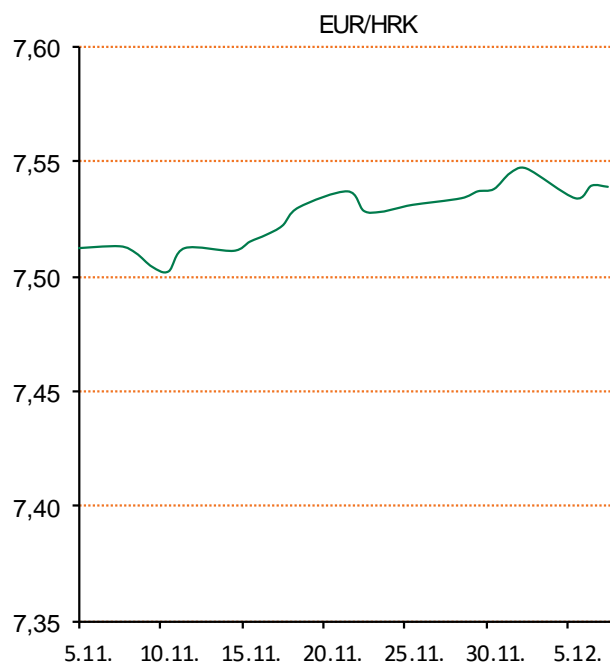
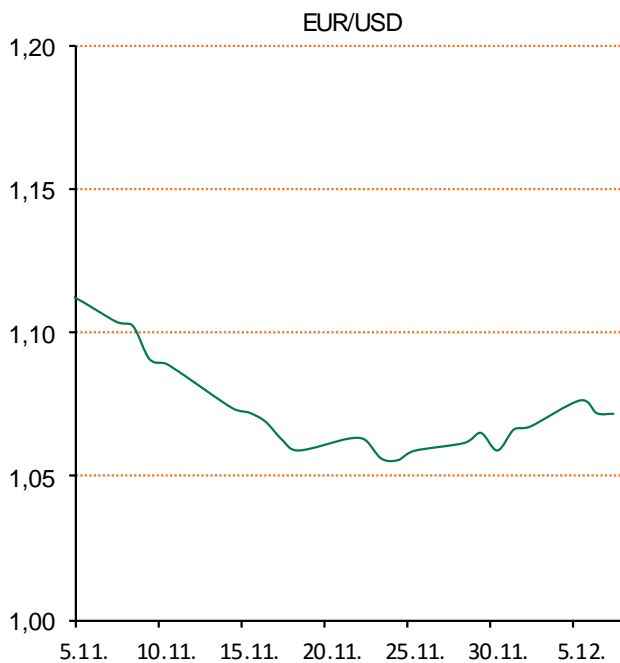
Pregled deviznog tržišta

	Spot rates		Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK	BID	ASK	
EURUSD	1,0728	1,0731	O/N	0,2	2	1Y	-0,22	-0,17
EURCHF	1,0827	1,0832	T/N	0,2	2	2Y	-0,15	-0,14
EURGBP	0,8500	0,8501	1W	3	15	3Y	-0,0962	-0,0462
EURJPY	122,45	122,48	2W	6	32	4Y	0,022	0,032
GBPUSD	1,2621	1,2622	1M	34	91	5Y	0,139	0,149
USDJPY	114,16	114,17	3M	139	305	7Y	0,3945	0,4025
GOLD	1170,46	1171,23	6M	170	606	9Y	0,643	0,651
BRENT	51,87	51,89	12M	380	1257	10Y	0,74	0,77

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,5100	7,5600
USDHRK	6,9984	7,0470
CHFHRK	6,9332	6,9825
GBPHRK	8,8343	8,8941
JPYHRK	6,1316	6,1739
AUDHRK	5,2037	5,2394
CADHRK	5,2683	5,3053
NOKHRK	0,8330	0,8387
DKKHRK	1,0097	1,0165
SEKHRK	0,7685	0,7739
HUFHRK	2,3984	2,4170
PLNHRK	1,6859	1,6977
CZKHRK	0,2776	0,2797

Utorak je na domaćem deviznom tržištu prošao uz blage deprecijacijske pritiske na kunu u odnosu na jedinstvenu europsku valutu. Tako je tečaj EUR/HRK porastao s razine 7,531 na 7,537 kuna za euro potaknut nešto većom potražnjom za devizama od strane korporativnog sektora. Današnje trgovanje vidimo unutar intervala 7,51 – 7,56. Ministarstvo financija je na jučerašnjoj aukciji izdalo 1,068 milijardi kunskih trezoraca, što je oko 200 milijuna kuna manje od iznosa koji je na dospjeću ovog tjedna.

Na inozemnim deviznim tržištima tečaj EUR/USD zadržao se iznad razina 1,07 dolara za euro, a od podataka ističemo podatke o kretanju BDP-a u eurozoni, koji je porastao za 0,30 posto, što je bilo u skladu s očekivanjima. Američke industrijske narudžbe su porasle u studenom za 2,70 posto nakon rasta od 0,60 posto u mjesecu prije, a predviđao se rast od 2,6 posto. Australaska centralna banka zadržala je referentnu kamatnu stopu u prosincu na rekordno niskoj razini od 1,50 posto, što je bilo u skladu sa očekivanjima.



Sport: Odigrane su posljednje utakmice u skupinama A,B,C i D Lige prvaka. Arsenal, PSG, Napoli, Benfica, Barcelona, Manchester City, Atletico Madrid i Bayern prošli su u drugu fazu natjecanja. Nogometaši Ludogoreca priredili su iznenađenje večeri u Ligi prvaka odigravši u Parizu 2-2 protiv Paris St Germaina čime je francuski prvak ispustio prvo mjesto u skupini A.

Pregled novčanog tržišta

Referentne kamatne stope na dan				06.12.2016	
Opis	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	0,43478	-0,780	-	0,54	
1W	0,46156	-0,791	-0,380	0,57	
2W			-0,373	0,61	
1M	0,65194	-0,830	-0,372	0,70	
3M	0,94806	-0,746	-0,315	0,87	
6M	1,291	-0,675	-0,219	0,99	
1Y	1,644	-0,506	-0,079	1,28	

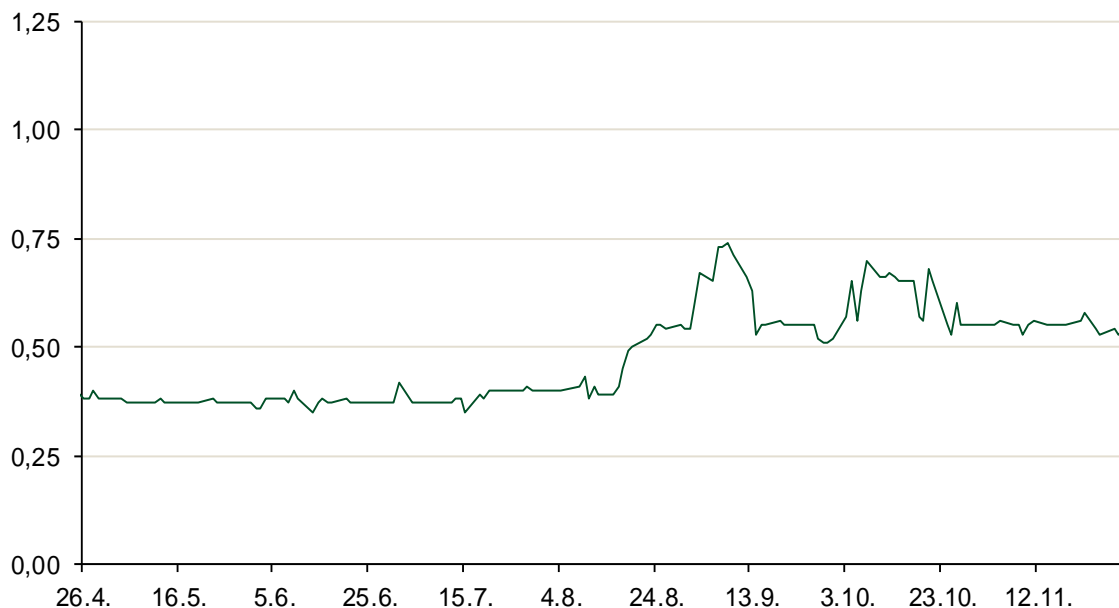
Vrijednost udjela fondova		05.12.2016
Fond		
PBZ Novčani fond		143,4524 HRK
PBZ Euro novčani		139,3440 EUR
PBZ Dollar		132,4464 USD
PBZ Short term bond		102,2777 HRK
PBZ Bond		130,5612 EUR
PBZ Conservative 10		110,9132 EUR
PBZ Flexible 30		100,3117 EUR
PBZ Global		15,2201 EUR
PBZ Equity		11,5989 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospjeća
364	HRK	0,65	1068	08.12.2016	07.12.2017
364	EUR/VK	0,17	29	27.10.2016	26.10.2017
455	EUR	0,70	1500	11.08.2016	09.11.2017

Kamatni swapovi			
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0,2100	1,1250	-0,7175
2 Y	-0,1600	1,3440	-0,6370
3 Y	-0,0720	1,5440	-0,5480
4 Y	0,0230	1,7070	-0,4350
5 Y	0,1390	1,8380	-0,3160
6 Y	0,2690	1,9500	-0,1950
7 Y	0,3990	2,0420	-0,0850
8 Y	0,5270	2,1180	0,0170
9 Y	0,6460	2,1810	0,1070
10 Y	0,7530	2,2350	0,1900

PBZ Referentne kamate						
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M	
Bid	0,00	0,10	0,20	0,40	0,50	
Ask	0,50	0,60	0,70	0,90	1,00	
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
Euro - Val. klauzula						
RHMF-O-19BA	5,375%	29.11.2019	111,75	112,45	1,33	1,11
RHMF-O-203E	6,500%	05.03.2020	115,85	116,55	1,47	1,27
RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	119,75	120,45	2,69	2,57
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	118,00	118,70	3,07	2,98
HRK - Kunske						
RHMF-O-172A	4,750%	08.02.2017	100,65	100,85	0,81	-0,37
RHMF-O-17BA	6,250%	25.11.2017	105,10	105,60	0,91	0,41
RHMF-O-187A	5,250%	10.07.2018	106,20	106,70	1,29	0,98
RHMF-O-203A	6,750%	05.03.2020	115,50	116,50	1,80	1,49
RHMF-O-217A	2,750%	08.07.2021	102,15	103,15	2,25	2,02
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	110,75	111,75	3,07	2,93
RHMF-O-26CA	4,250%	14.12.2026	109,80	110,80	3,10	2,99

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	96,56	0,36
Francuska	95,10	0,76
Austrija	101,74	0,57
Italija	94,26	1,89
Španjolska	98,56	1,46
Portugal	94,35	3,58
Češka	104,05	0,56
Grčka	79,69	6,71
Slovenija	135,88	1,06

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
Republika Hrvatska						
CROATIA USD 2017	6,250%	27.04.2017	101,50	102,00	2,27	0,99
CROATIA EUR 2018	5,875%	09.07.2018	108,45	108,95	0,49	0,20
CROATIA USD 2019	6,750%	05.11.2019	108,20	108,70	3,74	3,57
CROATIA USD 2020	6,625%	14.07.2020	108,35	108,85	4,10	3,96
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	108,55	109,05	4,18	4,05
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	106,55	107,05	2,57	2,48
CROATIA USD 2023	5,5%	04.04.2023.	105,00	105,50	4,58	4,49
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	108,00	108,50	4,67	4,59
CROATIA EUR 2025	3,000%	11.03.2025	99,75	100,25	3,03	2,96

CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	63	151	227
Italija	95	138	171
Spain	35	60	81

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9,125%	10.10.2020	103,60	104,60	7,81	7,45
AGROKOR 2019	9,875%	01.05.2019	103,20	104,20	8,37	7,91
ZG. HOLDING 2023 HRK	3,875%	15.07.2023	102,75	103,75	3,40	3,23
HEP USD	6,000%	09.11.2017	103,00	104,50	2,66	1,06
HEP USD	5,875%	23.10.2022	106,00	107,00	4,69	4,50

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

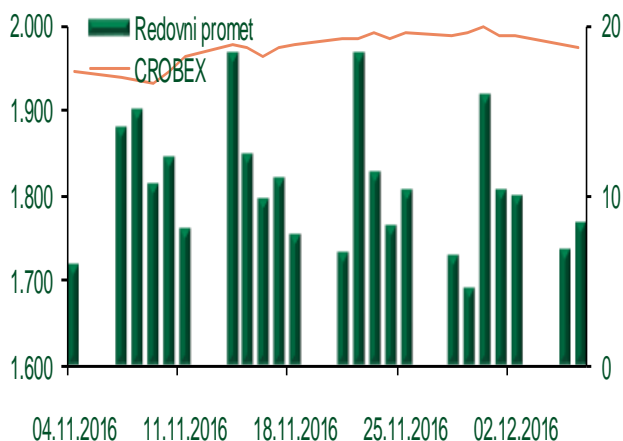
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 06.12.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	8.417,29
Redovni promet ('000 HRK)	8.417,29
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	348.284,22
Vrijednost CROBEX indeksa	1.975,23
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,02%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	16,90%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.149,91
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,25%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	16,24%

Izvor: Zagrebačka burza

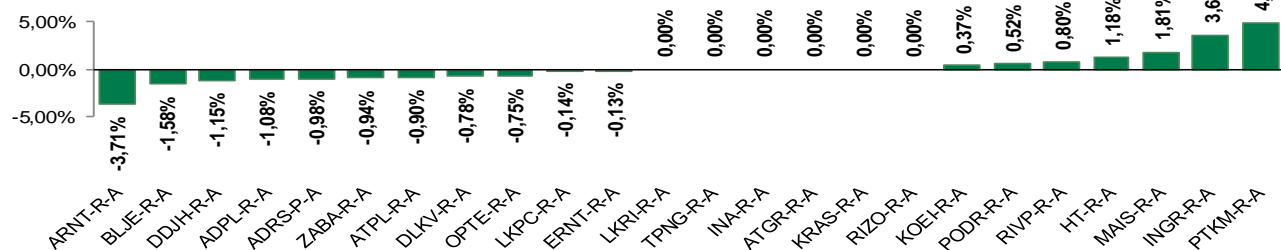
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 06.12.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
PODR-R-A	Podravka d.d.	373,12	0,52%	11,71%	1.202,92	2.022,31
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	170,00	1,18%	17,73%	1.162,73	13.921,05
AUHR-R-A	Auto Hrvatska d.d.	865,00	6,13%	92,22%	1.024,51	572,41
ADRS-P-A	Adris Grupa d.d.	451,67	-0,98%	23,75%	843,58	3.064,17
ATGR-R-A	Atlantic grupa d.d.	873,00	0,00%	4,81%	781,48	2.910,84

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 06.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	714,52	1,34%	10,93%
BELEXline	1.563,21	1,14%	13,24%
SBI TOP	703,40	0,03%	1,05%
SASX-10	693,72	0,59%	-0,76%
BIRS	563,44	0,23%	-14,50%
MONEX 20	10.957,59	-0,86%	-9,65%
MBI-10	2.208,50	0,00%	20,47%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 06.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	6779,84	+0,49%	8,61%
DAX 30	10775,32	+0,85%	0,30%
CAC 40	4631,94	+1,26%	-0,11%
DJIA	19251,78	+0,18%	10,48%
NASDAQ	5.333,00	+0,45%	6,50%
S&P 500	2212,23	+0,34%	8,23%
NIKKEI 225	18496,69	+0,74%	-2,82%

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.