

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

09. kolovoz 2016.

- jučerašnja situacija na domaćem terenu protekla u znaku stabilnijeg trgovanja
- tečaj se kretao oko razine 7.476
- interval trgovanja za domaći valutni par u tekućem danu vidimo unutar 7.45 – 7.50
- održana obrnuta REPO aukcija; za danas najavljena aukcija TZMF
- \$ zadržao dobitke u odnosu na konkurente
- u Njemačkoj zabilježen rast industrijske proizvodnje
- europski burzovni indeksi na početku tjedna u laganom plusu

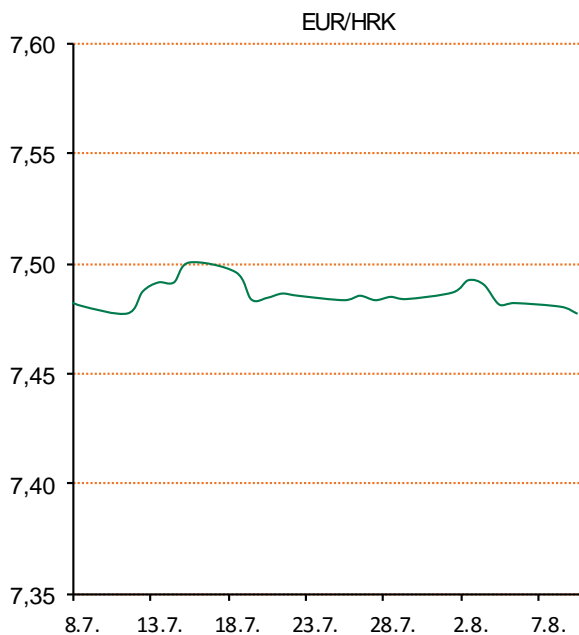
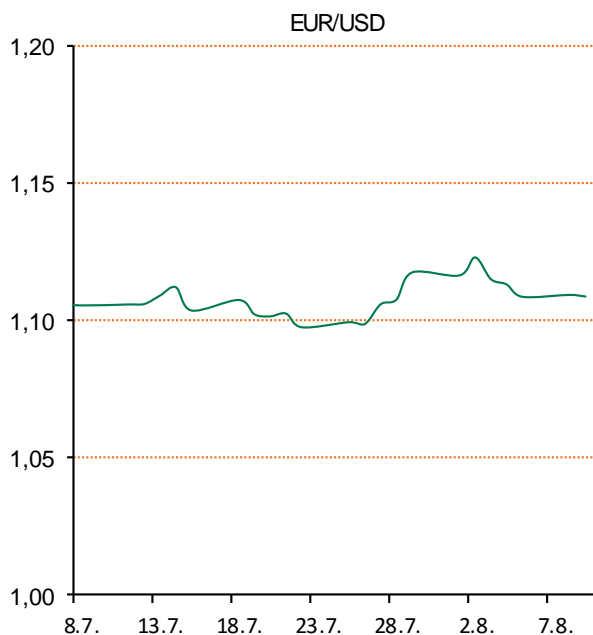
Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,1072	1,1076	O/N	1,6	3,2	1Y	-0,2249	-0,1849
EURCHF	1,0894	1,0899	T/N	1,6	3,2	2Y	-0,225	-0,215
EURGBP	0,8522	0,8525	1W	13	26	3Y	-0,225	-0,205
EURJPY	113,46	113,49	2W	23	45	4Y	-0,2075	-0,1775
GBPUSD	1,2992	1,2994	1M	50	99	5Y	-0,147	-0,137
USDJPY	102,46	102,49	3M	143	304	7Y	0,013	0,02
GOLD	1330,65	1332,15	6M	202	587	9Y	0,202	0,209
BRENT	42,83	42,85	12M	408	1082	10Y	0,279	0,309

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4500	7,5000
USDHRK	6,7263	6,7738
CHFHRK	6,8355	6,8845
GBPHRK	8,7390	8,8008
JPYHRK	6,5645	6,6103
AUDHRK	5,1415	5,1771
CADHRK	5,1034	5,1412
NOKHRK	0,7919	0,7976
DKKHRK	1,0018	1,0086
SEKHRK	0,7837	0,7892
HUFHRK	2,3909	2,4108
PLNHRK	1,7447	1,7577
CZKHRK	0,2754	0,2775

Na domaćem deviznom tržištu zabilježili smo stabilno trgovanje bez velikih promjena, tečaj EUR/HRK se kretao na razinama unutar 7,476 -7,481 kuna za euro. Ponuda i potražnja za devizama na međubankarskom tržištu bila je uravnotežena, dok je bilo od strane korporativnih klijenata bilo mirno. Današnje trgovanje vidimo unutar intervala 7,45-7,50. Na redovitoj obratnoj REPO aukciji HNB je plasirala 50 milijuna kuna na tjedan dana uz kamatu od 0,50 posto. Za danas je najavljena aukcija trezorskih zapisa.

Američki dolar zadržao je dobitke u odnosu na konkurente nakon podataka da je broj zaposlenih u SAD-u porastao u srpnju više nego se očekivalo. U Njemačkoj je zabilježen rast industrijske proizvodnje na 0,80 posto u srpnju, također više nego se očekivalo. Japanski bankarski krediti porasli su u drugom kvartalu na 2,1 posto sa 2,0 posto u prethodnom kvartalu. U takvim okolnostima američki dolar porastao je u odnosu na jen, euro i franak. USD/JPY je na 102,42, EUR/USD na 1,1077, dok je USD/CHF na 0,9838. Indeks dolara je porastao za 0,12 posto na 96,31.



Kino: Odred otpisanih - Skupina jedinstvenih superzlikovaca, koji se već nalaze u zatvoru visoke sigurnosti, regrutirani su za tajni zadatak vladine agencije Amande Waller (Viola Davis). Pod nazivom ODRED OTPISANIH kreću u pogibeljnu misiju, preopasnu za obične snage sigurnosti i vojske, koja im je dodijeljena u zamjenu za određene povlastice.

Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamatne stope na dan			08.08.2016	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	0,4189	-0,801	-	0,41	
1W	0,44235	-0,821	-0,377	0,47	
2W			-0,373	0,53	
1M	0,5039	-0,809	-0,369	0,61	
3M	0,79235	-0,752	-0,298	0,80	
6M	1,1607	-0,663	-0,185	0,94	
1Y	1,4751	-0,509	-0,046	1,28	

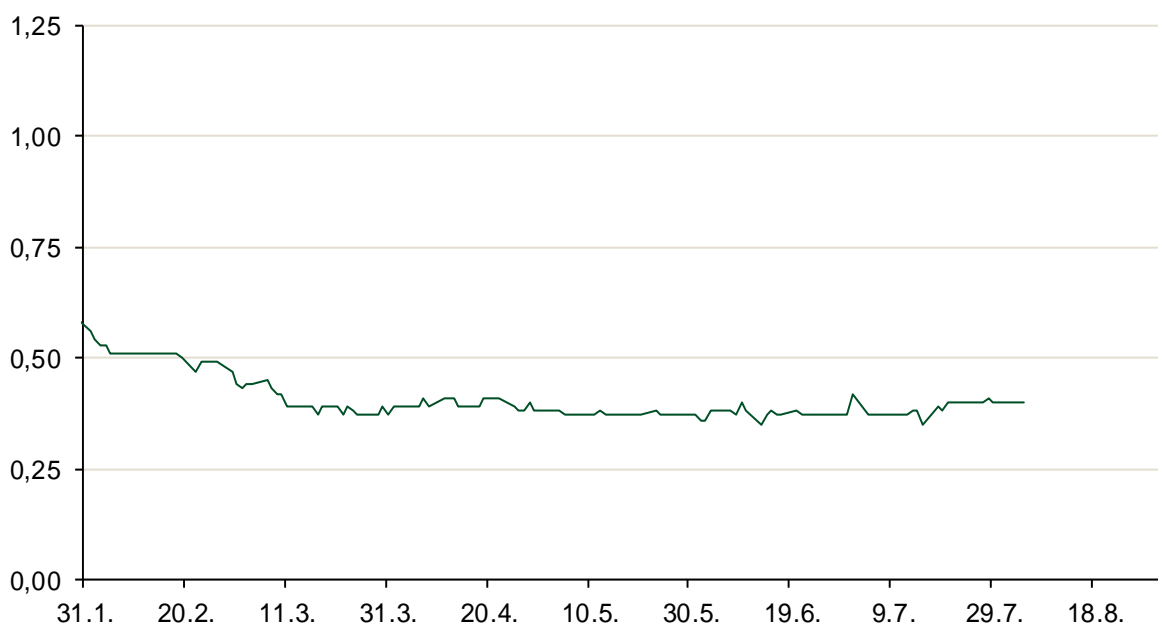
Vrijednost udjela fondova		04.08.2016
Fond		
PBZ Novčani fond	143,3587 HRK	HRK
PBZ Euro novčani	139,3082 EUR	EUR
PBZ Dollar	131,9419 USD	USD
PBZ Short term bond	101,5425 HRK	HRK
PBZ Bond	128,4527 EUR	EUR
PBZ Conservative 10	109,3193 EUR	EUR
PBZ Flexibile 30	100,8036 EUR	EUR
PBZ Global	14,7331 EUR	EUR
PBZ Equity	10,8127 EUR	EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospijeća
182	HRK	0,45	1	10.03.2016	08.09.2016
364	HRK	0,94	562	30.06.2016	29.07.2017
364	EUR/VK	0,25	16,00	27.05.2016	25.05.2017

	Kamatni sw apovi		
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0,2188	0,9320	-0,8550
2 Y	-0,2363	1,0040	-0,7110
3 Y	-0,2366	1,0630	-0,7100
4 Y	-0,2080	1,1200	-0,6840
5 Y	-0,1575	1,1810	-0,6350
6 Y	-0,0863	1,2450	-0,5780
7 Y	0,0013	1,3060	-0,5120
8 Y	0,0975	1,3640	-0,4490
9 Y	0,2010	1,4160	-0,3880
10 Y	0,2727	1,4640	-0,3330

PBZ Referente kamate					
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid	0,00	0,00	0,05	0,30	0,40
Ask	0,50	0,50	0,55	0,80	0,90
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	0,20	0,30	0,40	0,50	0,66
Ask	0,70	0,80	0,90	1,00	1,10

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	111,60	112,30	1,74	1,53
RHMF-O-203E	6,500%	05.03.2020	116,30	117,00	1,76	1,58
RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	117,70	118,40	3,20	3,09
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	115,50	116,20	3,49	3,40
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-172A	4,750%	08.02.2017	101,80	102,10	1,05	0,45
RHMF-O-17BA	6,250%	25.11.2017	106,20	106,70	1,37	0,99
RHMF-O-187A	5,250%	10.07.2018	106,45	106,95	1,80	1,54
RHMF-O-203A	6,750%	05.03.2020	115,00	116,00	2,34	2,04
RHMF-O-217A	2,750%	08.07.2021	99,60	100,40	2,84	2,66
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	106,50	107,50	3,64	3,50
RHMF-O-26CA	4,250%	14.12.2026	104,40	105,40	3,73	3,61

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	100,75	-0,07
Francuska	103,44	0,15
Austrija	106,69	0,09
Italija	104,54	1,11
Španjolska	108,90	0,99
Portugal	100,52	2,81
Češka	106,29	0,35
Grčka	69,93	8,31
Slovenija	139,15	0,87

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA USD 2017	6,250%	27.04.2017	103,00	103,30	1,96	1,54
CROATIA EUR 2018	5,875%	09.07.2018	109,55	109,85	0,81	0,66
CROATIA USD 2019	6,750%	05.11.2019	110,20	110,50	3,39	3,30
CROATIA USD 2020	6,625%	14.07.2020	110,60	111,10	3,70	3,57
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	110,60	111,10	3,85	3,73
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	105,30	105,80	2,87	2,78
CROATIA USD 2023	5,5%	04.04.2023	108,50	109,00	4,03	3,95
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	111,50	112,00	4,19	4,11
CROATIA EUR 2025	3,000%	11.03.2025	98,75	99,25	3,17	3,10

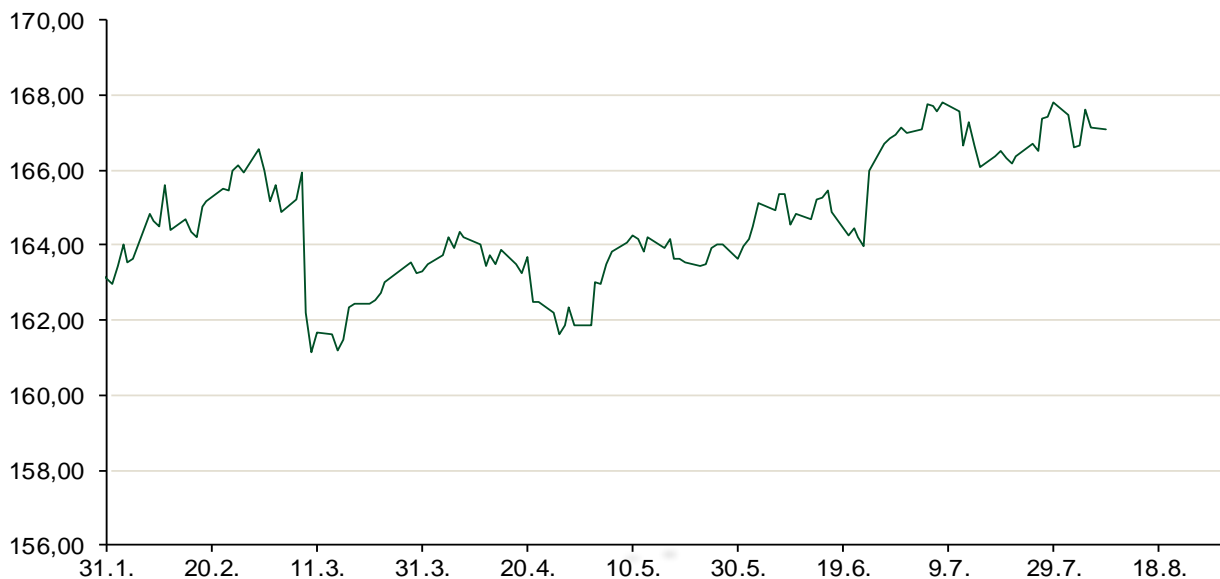
CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	68	151	227
Italija	49	92	122
Spain	24	57	83

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9,125%	10.10.2020	106,00	107,00	7,14	6,82
AGROKOR 2019	9,875%	01.05.2019	105,40	106,40	7,63	7,23
ZG. HOLDING 2023 HRK	3,875%	15.07.2023	98,30	99,30	4,16	3,99
HEP USD	6,000%	09.11.2017	105,20	106,70	1,75	0,58
HEP USD	5,875%	23.10.2022	107,00	108,50	4,56	4,30

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

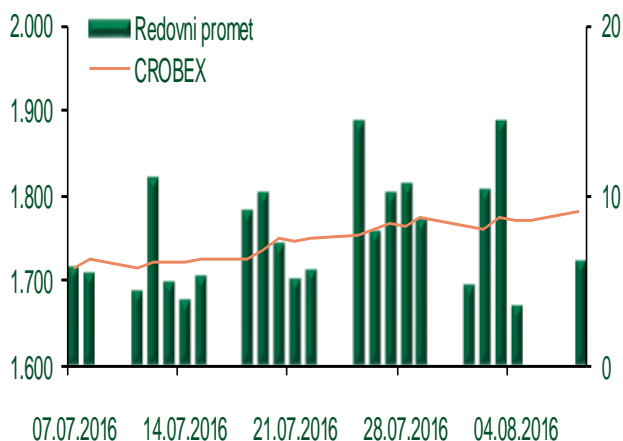
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 08.08.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	6.203,47
Redovni promet ('000 HRK)	6.203,47
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	6.500,50
Vrijednost CROBEX indeksa	1.780,90
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,60%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	5,40%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.033,05
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,61%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	4,42%

Izvor: Zagrebačka burza

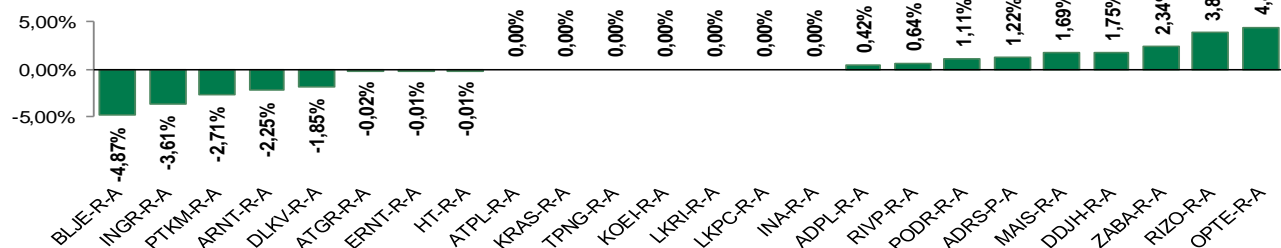
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 08.08.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	142,53	-0,01%	-1,30%	1.658,45	11.671,57
HDEL-R-A	Hidroelektra niskogradnja d.d.	20,00	-19,68%	-9,09%	1.100,00	12,48
ATGR-R-A	Atlantic grupa d.d.	814,03	-0,02%	-2,27%	560,69	2.714,22
CKML-R-A	Čakovečki mlinoi d.d.	5.400,00	0,00%	8,00%	540,00	567,00
HUPZ-R-A	HUP Zagreb d.d.	2.150,00	1,42%	11,98%	509,53	1.065,54

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 08.08.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	631,12	-0,78%	-2,02%
BELEXline	1.385,85	-0,49%	0,39%
SBI TOP	716,51	0,82%	2,93%
SASX-10	678,43	0,02%	-2,95%
BIRS	572,07	0,45%	-13,19%
MONEX 20	10.846,49	-0,84%	-10,57%
MBI-10	1.862,97	0,07%	1,62%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 08.08.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	6809,13	+0,23%	9,08%
DAX 30	10432,36	+0,63%	-2,89%
CAC 40	4415,46	+0,11%	-4,78%
DJIA	18529,29	-0,08%	6,34%
NASDAQ	5213,14	-0,15%	4,11%
S&P 500	2180,89	-0,09%	6,70%
NIKKEI 225	16765,52	+0,69%	-11,92%

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.