

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

22. studeni 2016.

- deprecijacija kune naspram eura
- „range” trgovanja 7,51 – 7,56
- euro ojačao naspram dolara
- dolar skliznuo prema jenu
- rast cijena nafte
- CROBEX i svjetski indeksi u porastu

Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,0641	1,0646
EURCHF	1,0736	1,0737
EURGBP	0,8519	0,8524
EURJPY	117,83	117,87
GBPUSD	1,2489	1,249
USDJPY	110,72	110,73
GOLD	1217,88	1218,03
BRENT	45,10	45,12

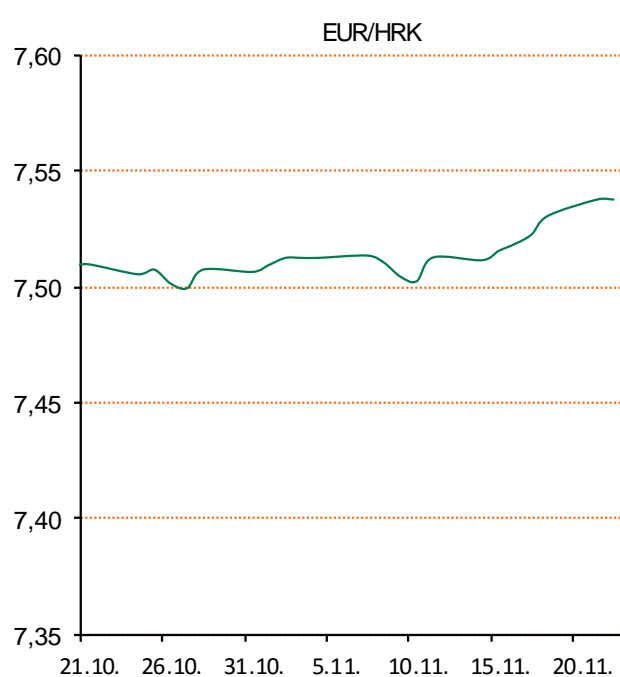
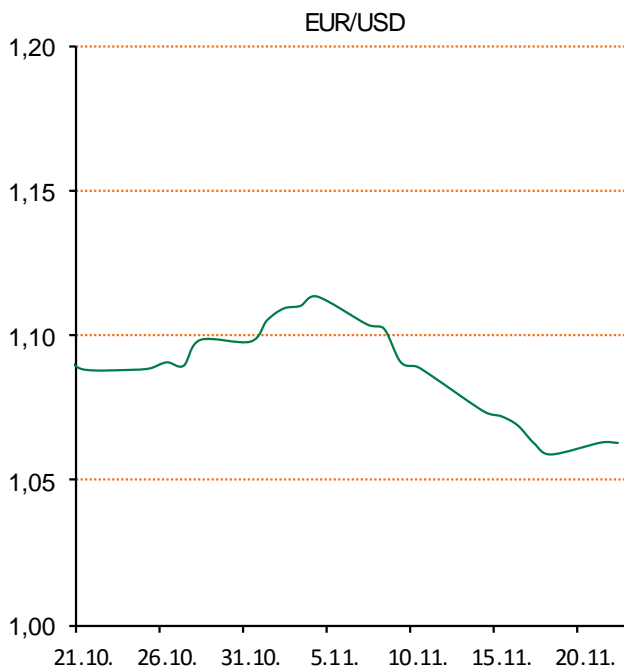
	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	1,1	2,7
T/N	1,1	2,7
1W	7	21
2W	15	41
1M	42	97
3M	140	308
6M	197	633
12M	411	1288

	Interest rate sw ap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,22	-0,17
2Y	-0,16	-0,13
3Y	-0,104	-0,064
4Y	-0,001	0,0035
5Y	0,0975	0,1025
7Y	0,3235	0,3285
9Y	0,5425	0,5475
10Y	0,624	0,664

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,5100	7,5600
USDHRK	7,0543	7,1046
CHFHRK	6,9945	7,0417
GBPHRK	8,8104	8,8743
JPYHRK	6,3714	6,4160
AUDHRK	5,2233	5,2591
CADHRK	5,2713	5,3105
NOKHRK	0,8292	0,8351
DKKHRK	1,0093	1,0161
SEKHRK	0,7667	0,7720
HUFHRK	2,4330	2,4532
PLNHRK	1,6987	1,7114
CZKHRK	0,2774	0,2796

Dobro jutro. Ponedjeljak je na domaćem deviznom tržištu donio nastavak blagih deprecijacijskih pritisaka na domaću valutu u odnosu na euro. Dan smo otvorili s kotacijom EURHRK 7,529 i zaključili s kotacijom 7,534. Ključni indeksi Zagrebačke burze trgovanje su zaključili rastom. CROBEX je rastao 0,22% na 1.982,94 boda. CROBEX10 je rastao za 0,12% na 1.145,41 boda. Ukupni redovni promet na ZSE-u iznosio je 6,6 milijuna kuna.

Euro je u ponedjeljak odskočio s najnižih razina u 11 mjeseci prema dolaru, jer je razvoj situacije na političkom planu, po mišljenju nekih promatrača, učinio manje neizvjesnim izbore u Francuskoj i Njemačkoj u 2017. godini, pruživši blagu podršku europskoj zajedničkoj valuti. Euro je u takvom ozračju prema dolaru ojačao 0,5% na 1,0645 dolara i time odskočio s najnižih razina od prosinca 2015. godine, na koje je u jednom trenutku skliznuo u trgovanju u petak. Dolar je skliznuo i 0,2% prema jenu, na 110,70 jena, nakon što je u ranijem trgovanju nakratko dosegnuo najvišu razinu u šest mjeseci od 111,190 jena. Cijene nafte skočile su u ponedjeljak na međunarodnim tržištima iznad razine od 48 dolara jer su trgovce ohrabrile nove naznake dogovora o smanjenju proizvodnje, a dodatnu potporu pružio im je i slabiji dolar. Na londonskom je tržištu cijena barela porasla 1,44 dolara u odnosu na prethodno zatvaranje i iznosila je 48,30 dolara. Na američkom tržištu barelom se trgovalo po 2,01 dolar višoj cijeni, od 47,70 dolara.



Film Dolazak - Radnja ovog inteligentnog znanstveno-fantastičnog misterioznog trilera fokusirana je na dolazak izvanzemaljaca i naš prvi kontakt s njima. Sveukupno dvanaest letjelica jajastog oblika sletjelo je na različitim lokacijama diljem svijeta. Američka vojska uskoro regrutira doktoricu Louise Banks (Adams), najbolju prevoditeljicu u svijetu, čiji je zadatak uz pomoć fizičara Iana Donnellyja (Renner) otkriti jesu li naši posjetitelji došli u miru ili predstavljaju prijetnju potpunom čovječanstvu.

Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamatne stope na dan			21.11.2016	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	0,43367	-0,780	-	0,56	
1W	0,45978	-0,789	-0,380	0,60	
2W			-0,373	0,62	
1M	0,566	-0,787	-0,371	0,72	
3M	0,91622	-0,739	-0,312	0,88	
6M	1,27933	-0,663	-0,219	0,99	
1Y	1,62067	-0,492	-0,078	1,30	

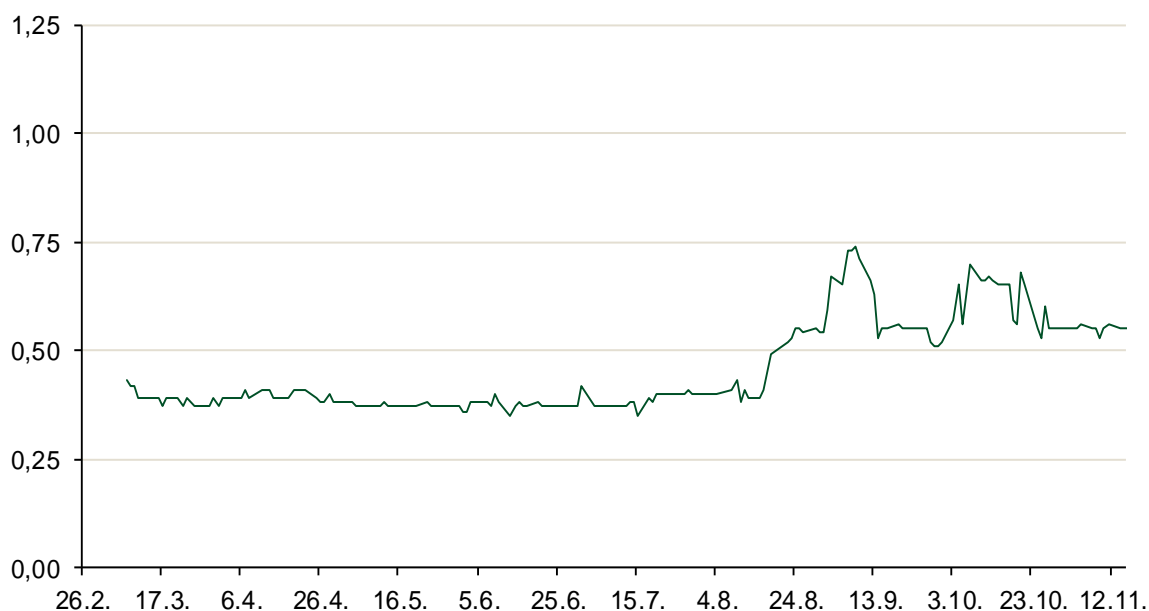
Vrijednost udjela fondova		18.11.2016
Fond		
PBZ Novčani fond		143,4437 HRK
PBZ Euro novčani		139,3414 EUR
PBZ Dollar		132,3422 USD
PBZ Short term bond		102,2882 HRK
PBZ Bond		130,2656 EUR
PBZ Conservative 10		110,7058 EUR
PBZ Flexible 30		100,4134 EUR
PBZ Global		15,1342 EUR
PBZ Equity		11,5292 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdavanja	Dat. Dospjeća
364	HRK	0,80	1200	27.10.2016	26.10.2017
364	EUR/VK	0,17	29,00	27.10.2016	26.10.2017
455	EUR	0,70	1.500,00	11.08.2016	09.11.2017

	Kamatni swapovi		
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0,2200	1,0790	-0,7300
2 Y	-0,1550	1,2890	-0,6820
3 Y	-0,1040	1,4810	-0,5910
4 Y	-0,0135	1,6410	-0,4850
5 Y	0,0790	1,7690	-0,3710
6 Y	0,1971	1,8740	-0,2720
7 Y	0,3160	1,9590	-0,1720
8 Y	0,4300	2,0300	-0,0750
9 Y	0,5370	2,0880	0,0080
10 Y	0,6200	2,1370	0,0850

PBZ Referente kamate						
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M	
Bid	0,00	0,10	0,25	0,40	0,50	
Ask	0,50	0,60	0,75	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
<i>Euro - Val. klauzula</i>						
RHMF-O-19BA	5,375%	29.11.2019	1120,00	1120,70	-64,42	-64,44
RHMF-O-203E	6,500%	05.03.2020	116,55	117,25	1,32	1,13
RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	119,65	120,35	2,73	2,61
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	117,60	118,30	3,14	3,04
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-172A	4,750%	08.02.2017	100,70	100,90	1,33	0,38
RHMF-O-17BA	6,250%	25.11.2017	105,10	105,60	1,12	0,64
RHMF-O-187A	5,250%	10.07.2018	106,25	106,75	1,35	1,06
RHMF-O-203A	6,750%	05.03.2020	116,35	117,35	1,61	1,30
RHMF-O-217A	2,750%	08.07.2021	101,90	102,90	2,31	2,08
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	110,25	111,25	3,13	3,00
RHMF-O-26CA	4,250%	14.12.2026	109,30	110,30	3,16	3,05

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	97,70	0,24
Francuska	95,54	0,71
Austrija	102,22	0,52
Italija	93,30	2,00
Španjolska	97,79	1,54
Portugal	93,85	3,64
Češka	103,96	0,57
Grčka	78,23	6,94
Slovenija	136,38	1,02

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA USD 2017	6,250%	27.04.2017	101,50	102,00	2,65	1,49
CROATIA EUR 2018	5,875%	09.07.2018	108,45	108,95	0,62	0,33
CROATIA USD 2019	6,750%	05.11.2019	108,65	109,15	3,63	3,46
CROATIA USD 2020	6,625%	14.07.2020	108,85	109,35	3,99	3,84
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	108,54	109,04	4,20	4,08
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	106,30	106,80	2,63	2,54
CROATIA USD 2023	5,5%	04.04.2023.	105,30	105,80	4,53	4,44
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	108,15	108,65	4,65	4,57
CROATIA EUR 2025	3,000%	11.03.2025	99,20	99,70	3,11	3,04

CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	67	152	227
Italija	78	130	171
Spain	33	60	85

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9,125%	10.10.2020	103,45	104,45	7,87	7,52
AGROKOR 2019	9,875%	01.05.2019	102,95	103,95	8,50	8,05
ZG. HOLDING 2023 HRK	3,875%	15.07.2023	102,75	103,75	3,40	3,24
HEP USD	6,000%	09.11.2017	103,00	104,50	2,80	1,26
HEP USD	5,875%	23.10.2022	106,00	107,00	4,70	4,51

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

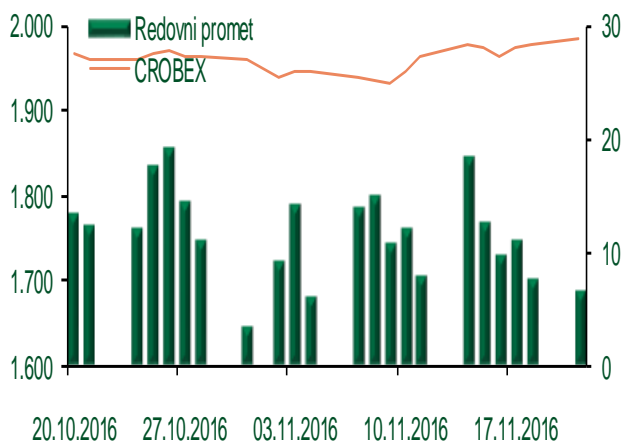
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 21.11.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	6.616,77
Redovni promet ('000 HRK)	6.616,77
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	52.826,84
Vrijednost CROBEX indeksa	1.982,94
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,22%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	17,36%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.145,41
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,12%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	15,78%

Izvor: Zagrebačka burza

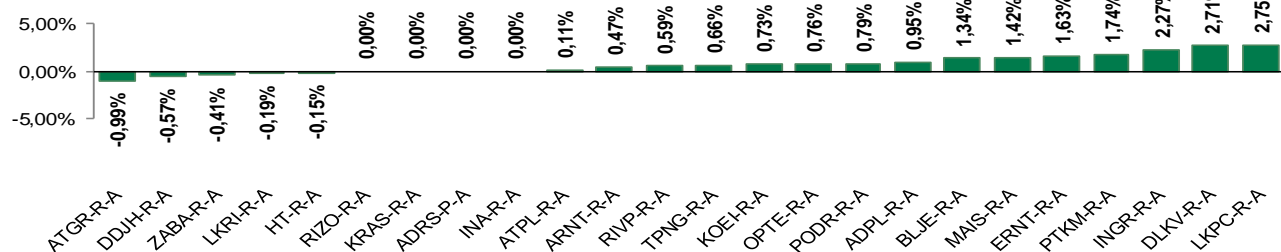
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 21.11.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
ZABA-R-A	Zagrebačka banka d.d.	49,00	-0,41%	32,50%	1.254,19	3.138,37
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	34,00	0,59%	41,25%	575,63	4.284,94
AUHR-R-A	Auto Hrvatska d.d.	825,00	3,13%	83,33%	456,27	545,94
JMNC-R-A	Jamnica d.d.	136.000,00	0,00%	18,37%	407,00	3.009,14
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	162,50	-0,15%	12,53%	381,51	13.306,89

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 21.11.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	679,86	0,98%	5,55%
BELEXline	1.514,24	0,69%	9,69%
SBI TOP	714,66	0,46%	2,67%
SASX-10	709,69	0,00%	1,52%
BIRS	561,15	-0,04%	-14,85%
MONEX 20	10.950,70	-0,82%	-9,71%
MBI-10	2.253,39	0,00%	22,92%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 21.11.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	6777,96	+0,03%	8,58%
DAX 30	10685,13	+0,19%	-0,54%
CAC 40	4529,58	+0,56%	-2,32%
DJIA	18956,69	+0,47%	8,79%
NASDAQ	5368,86	+0,89%	7,22%
S&P 500	2198,18	+0,75%	7,55%
NIKKEI 225	18162,94	+0,31%	-4,57%

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.