

# Dnevni izvještaj financijskih tržišta

**28. listopada 2016.**

- EURHRK unutar 7,48 – 7,53
- Američki dolar ojačao na deviznim tržištima
- EURUSD blago iznad 1,09
- Indeksi u SAD u padu, Europa u laganom porastu

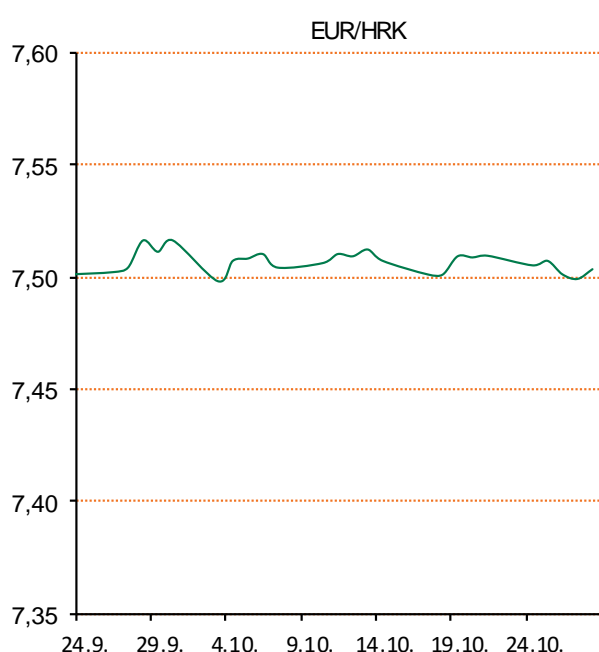
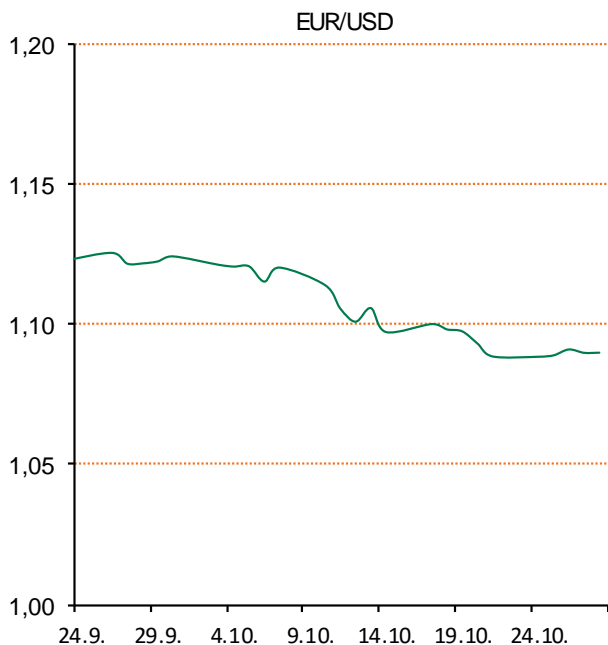
# Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,0916	1,0920	O/N	3	9	1Y	-0,2195	-0,1695
EURCHF	1,0839	1,0841	T/N	2	6	2Y	-0,165	-0,159
EURGBP	0,8965	0,8969	1W	7	20	3Y	-0,136	-0,096
EURJPY	114,91	114,97	2W	15	40	4Y	-0,0658	-0,0458
GBPUSD	1,2174	1,2178	1M	41	98	5Y	0,021	0,025
USDJPY	105,27	105,29	3M	132	299	7Y	0,2123	0,2323
GOLD	1267,95	1268,10	6M	196	615	9Y	0,432	0,444
BRENT	48,42	48,44	12M	409	1252	10Y	0,5251	0,5451

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4800	7,5300
USDHRK	6,8498	6,8981
CHFHRK	6,8997	6,9471
GBPHRK	8,3398	8,3993
JPYHRK	6,5060	6,5530
AUDHRK	5,1862	5,2223
CADHRK	5,1149	5,1508
NOKHRK	0,8277	0,8337
DKKHRK	1,0054	1,0122
SEKHRK	0,7582	0,7634
HUFHRK	2,4179	2,4368
PLNHRK	1,7266	1,7394
CZKHRK	0,2766	0,2788

Na domaćem deviznom tržištu zabilježili smo stabilno trgovanje bez velikih promjena, tečaj EUR/HRK se kretao na razinama unutar 7,497 -7,502 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 7,48-7,53.

Dolar je jučer ojačao nakon što je broj nezaposlenih u SAD-u koji su podnijeli zahtjev za pomoć pao za 3000, dok su analitičari očekivali 6000 zahtjeva. Narudžbe trajnih dobara pale su za 0,10 posto u rujnu, dok se očekivao rast od 0,10 posto. U takvim okolnostima EURUSD se spustio na razine 1,0901 dolara za euro. Američka valuta ojačala je i u odnosu na jen, na 105,33, dok je u odnosu na funtu na razinama 1,2215 dolara za funtu. Indeks dolara porastao je za 0,05 posto. Cijene nafte su u jučer na međunarodnim tržištima prekoračile 50 dolara nakon što je pad zaliha sirove nafte u SAD-u ublažio sumnje ulagača da će OPEC uspjeti provesti dogovoreno smanjenje proizvodnje.



Recept: Punjene role tikvica - tikvice (2 komada) narežite po dužini na tanje trake pa ih ispecite na grill tavi. Na svaku posluženu plošku stavite uži komad sira, malo zelene salate te sjeckane sušene rajčice. Pokapajte maslinovim uljem. Zarolajte nježno tikvicu te prstima ugurajte sastojke ako vam budu malo curili iz rola.

# Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamatne stope na dan			27.10.2016	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	0,43433	-0,785	-	0,55	
1W	0,45589	-0,795	-0,379	0,57	
2W			-0,374	0,63	
1M	0,53478	-0,785	-0,372	0,71	
3M	0,89039	-0,728	-0,312	0,88	
6M	1,261	-0,643	-0,213	0,99	
1Y	1,57956	-0,490	-0,070	1,30	

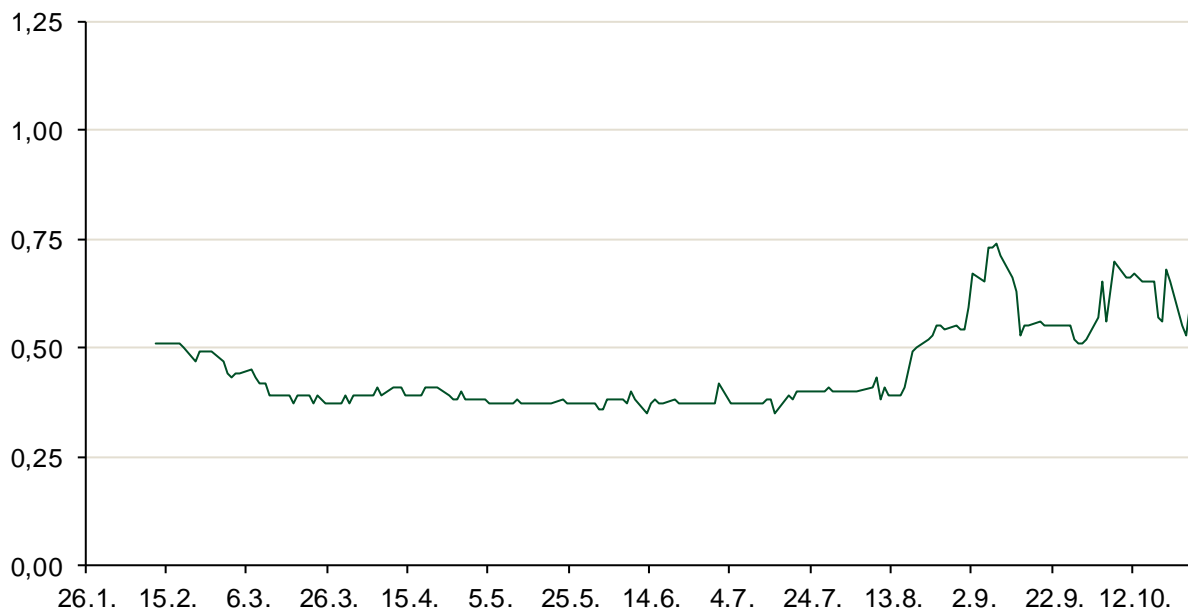
Vrijednost udjela fondova		26.10.2016
Fond		
PBZ Novčani fond		143,4347 HRK
PBZ Euro novčani		139,3372 EUR
PBZ Dollar		132,2486 USD
PBZ Short term bond		102,3525 HRK
PBZ Bond		131,1952 EUR
PBZ Conservative 10		111,6373 EUR
PBZ Flexibile 30		101,4589 EUR
PBZ Global		15,0780 EUR
PBZ Equity		11,6976 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospijeća
364	HRK	0,80	1200	25.10.2016	26.10.2017
364	EUR/VK	0,17	29,00	25.10.2016	26.10.2017
455	EUR	0,70	1.500,00	11.08.2016	09.11.2017

	Kamatni sw apovi		
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0,2200	1,0030	-0,6850
2 Y	-0,1650	1,1060	-0,6280
3 Y	-0,1330	1,1940	-0,5930
4 Y	-0,0675	1,2840	-0,5250
5 Y	0,0150	1,3700	-0,4610
6 Y	0,1040	1,4530	-0,3840
7 Y	0,2080	1,5290	-0,3010
8 Y	0,3040	1,5980	-0,2210
9 Y	0,4090	1,6590	-0,1470
10 Y	0,5000	1,7130	-0,0700

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	112,80	113,50	1,13	0,91
RHMF-O-203E	6,500%	05.03.2020	117,55	118,25	1,13	0,94
RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	121,00	121,70	2,53	2,42
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	120,60	121,30	2,76	2,67
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-172A	4,750%	08.02.2017	101,10	101,30	0,65	-0,08
RHMF-O-17BA	6,250%	25.11.2017	105,65	106,15	0,91	0,46
RHMF-O-187A	5,250%	10.07.2018	106,50	107,00	1,35	1,06
RHMF-O-203A	6,750%	05.03.2020	116,00	117,00	1,80	1,49
RHMF-O-217A	2,750%	08.07.2021	103,00	104,00	2,07	1,85
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	110,85	111,85	3,07	2,93
RHMF-O-26CA	4,250%	14.12.2026	109,70	110,70	3,12	3,01

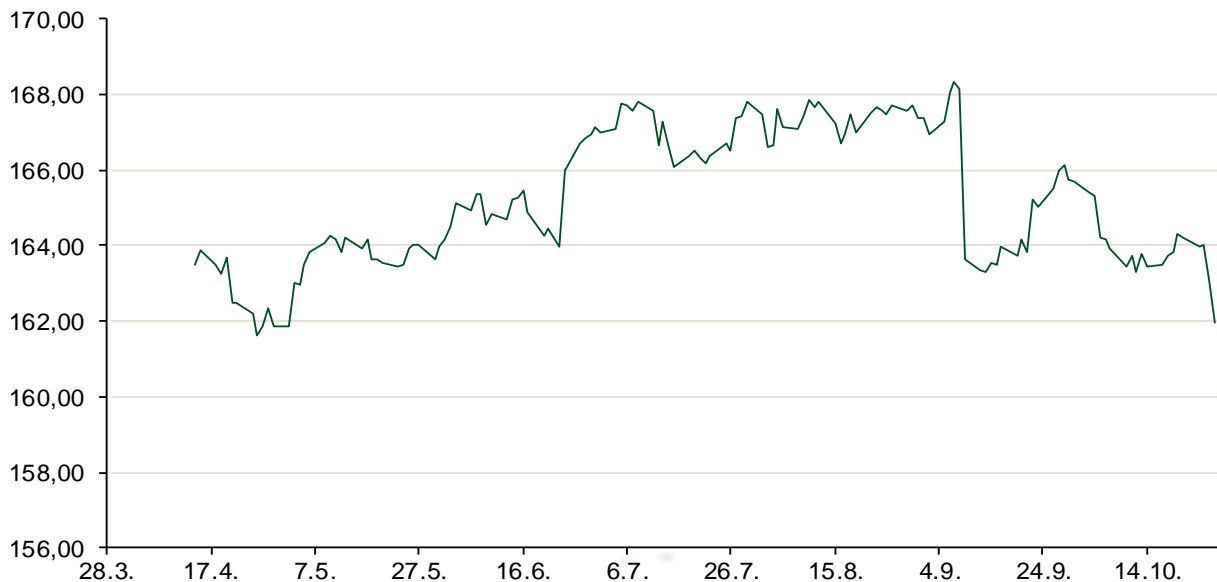
Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina		
Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	98,23	0,18
Francuska	97,80	0,48
Austrija	103,76	0,37
Italija	96,60	1,62
Španjolska	100,68	1,23
Portugal	96,50	3,30
Češka	104,69	0,50
Grčka	70,14	8,39
Slovenija	139,26	0,78

Eurobonds Rep. Hrvatske						
Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA USD 2017	6,250%	27.04.2017	102,05	102,55	1,99	0,98
CROATIA EUR 2018	5,875%	09.07.2018	109,65	109,95	0,14	-0,03
CROATIA USD 2019	6,750%	05.11.2019	109,70	110,20	3,34	3,17
CROATIA USD 2020	6,625%	14.07.2020	110,80	111,30	3,49	3,35
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	111,00	111,50	3,64	3,53
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	108,10	108,60	2,31	2,22
CROATIA USD 2023	5,5%	04.04.2023	109,10	109,60	3,88	3,80
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	112,60	113,10	3,98	3,90
CROATIA EUR 2025	3,000%	11.03.2025	102,00	102,50	2,73	2,66

CDS Pregled			
Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	43	126	203
Italija	59	105	139
Spain	26	49	70

Hrvatske korporativne obveznice						
AGROKOR 2020	9,125%	10.10.2020	103,70	104,70	7,81	7,46
AGROKOR 2019	9,875%	01.05.2019	103,00	104,00	8,52	8,08
ZG. HOLDING 2023 HRK	3,875%	15.07.2023	102,50	103,50	3,45	3,28
HEP USD	6,000%	09.11.2017	104,50	106,00	1,54	0,12
HEP USD	5,875%	23.10.2022	109,00	110,50	4,16	3,89

Bund futures



# Pregled dioničkog tržišta

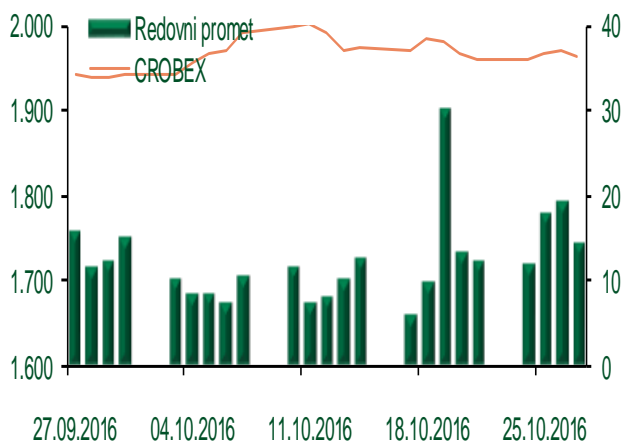
## Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 27.10.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	14.474,68
Redovni promet ('000 HRK)	14.474,68
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	328.216,88
<b>Vrijednost CROBEX indeksa</b>	<b>1.964,78</b>
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,26%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	16,28%
<b>Vrijednost CROBEX10 indeksa</b>	<b>1.135,06</b>
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,00%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	14,74%

Izvor: Zagrebačka burza

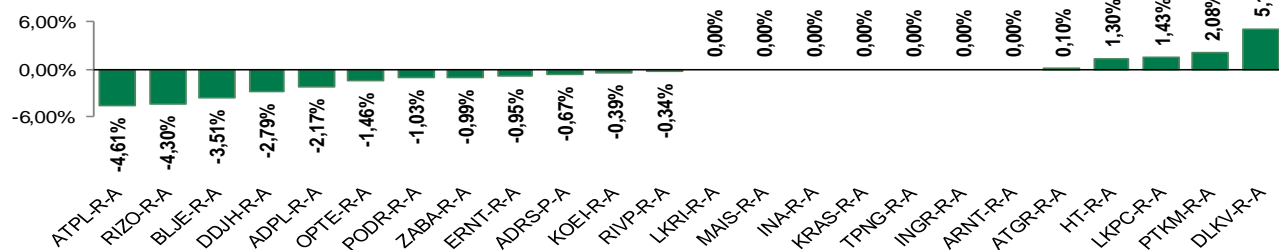
## Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



## Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 27.10.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	164,11	1,30%	13,65%	4.779,81	13.438,73
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	32,54	-0,34%	35,19%	2.830,69	4.100,94
AUHR-R-A	Auto Hrvatska d.d.	820,00	1,49%	82,22%	1.035,93	542,63
ADRS-P-A	Adris Grupa d.d.	447,00	-0,67%	22,47%	774,00	3.032,49
LKPC-R-A	Luka Ploče d.d.	580,00	1,43%	-17,14%	582,35	129,12

## Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



## Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 27.10.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	675,07	-0,21%	4,81%
BELEXline	1.485,15	-0,46%	7,59%
SBI TOP	749,43	0,16%	7,66%
SASX-10	708,37	0,50%	1,33%
BIRS	577,16	0,60%	-12,42%
MONEX 20	11.142,96	-0,07%	-8,12%
MBI-10	2.046,98	0,00%	11,66%

Izvor: službene stranice burzi regije

## Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 27.10.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	6986,57	+0,41%	11,92%
DAX 30	10717,08	+0,07%	-0,24%
CAC 40	4533,57	-0,02%	-2,23%
DJIA	18169,68	-0,16%	4,27%
NASDAQ	5215,98	-0,65%	4,17%
S&P 500	2133,04	-0,30%	4,36%
NIKKEI 225	17446,41	+0,63%	-8,34%

Izvor: Bloomberg

# Kontakti

## Riznica i ALM

Prodaja rizničnih proizvoda  
[treasurysales@pbz.hr](mailto:treasurysales@pbz.hr)

01 4891 301

Riznica  
[treasury@pbz.hr](mailto: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](mailto: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.