

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

10. veljače 2017.

- valutni par EUR/HRK volatilan
- deprecijacija kune do razine 7.472
- američki dolar ojačao u odnosu na glavne valute
- USD/JPY na najvišoj razini od 01. veljače
- CROBEX u minusu, svjetski indeksi u porastu

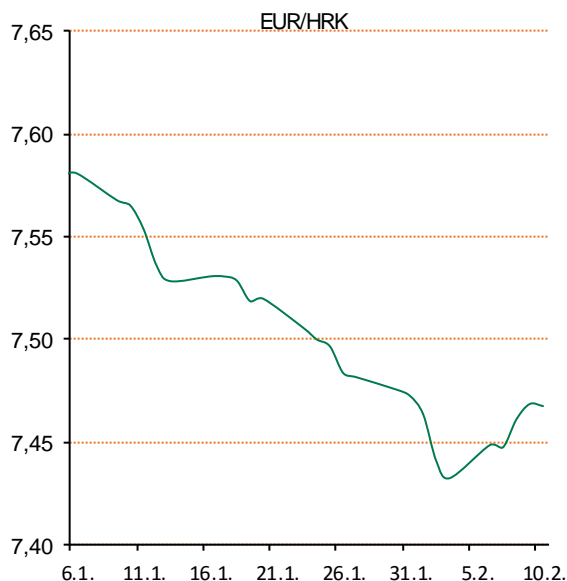
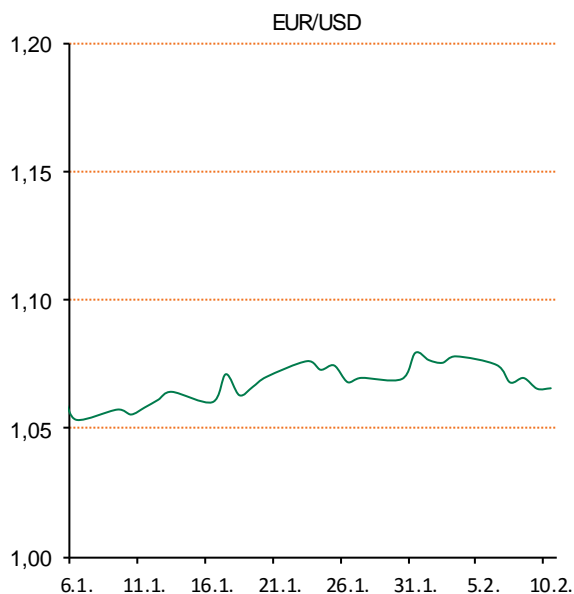
Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,0636	1,0641	O/N	-0,9	2,8	1Y	-0,23	-0,18
EURCHF	1,0668	1,0673	T/N	-0,3	0,9	2Y	-0,147	-0,137
EURGBP	0,8530	0,8534	1W	-2	7	3Y	-0,081	-0,041
EURJPY	120,99	121,00	2W	-3	15	4Y	0,0186	0,0386
GBPUSD	1,2467	1,2469	1M	0	35	5Y	0,13	0,15
USDJPY	113,74	113,75	3M	9	157	7Y	0,3781	0,3981
GOLD	1223,01	1223,15	6M	37	338	9Y	0,626	0,646
BRENT	53,32	53,34	12M	227	871	10Y	0,744	0,751

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4500	7,5000
USDHRK	7,0012	7,0515
CHFHRK	6,9802	7,0304
GBPHRK	8,7298	8,7925
JPYHRK	6,1570	6,1989
AUDHRK	5,3470	5,3841
CADHRK	5,3237	5,3602
NOKHRK	0,8353	0,8414
DKKHRK	1,0021	1,0089
SEKHRK	0,7853	0,7908
HUFHRK	2,4156	2,4331
PLNHRK	1,7298	1,7419
CZKHRK	0,2755	0,2777

Dobro jutro! Četvrtak nam je donio poveću volatilnost najpoznatijeg domaćeg valutnog para EUR/HRK. Trgovinski dan je otvoren na razini 7.456, kuna je ubrzo uslijed poveće potražnje za eurima počela slabiti. High je bio na razini 7.472. Kraj dana ipak je uspjela dočekati na razini 7.465. Današnje trgovanje očekujemo u intervalu 7.45 – 7.50. Ključni indeksi Zagrebačke burze pali su drugi dan zaredom. CROBEX je umanjen za 0.38 posto na 2.176,26 bodova. CROBEX 10 je također pao za 0.38 posto na 1.248,59 bodova. Ukupni redovni promet na ZSE iznosio je 11.7 milijuna kuna, 7.4 milijuna manje u odnosu na prethodni dan.

Strano devizno tržište u znaku američkog dolara koji je ojačao u odnosu na sve glavne valute. To je posljedica zaloga predsjednika Trampa za reviziju poreza na poslovanje. Dolar je također blizu najvećeg tjednog dobitka u odnosu na jen uoči sastanka Trampa sa japanskim premijerom. USD/JPY raste 0.5 posto, na 113.80, najvišu razinu od 01. veljače. Australijski dolar je ojačao nakon objave Kine da je trgovina u siječnju značajno porasla. AUD/USD raste 0.4 posto na 0.7655.



Recept: Jednostavni muffini – sastojci: 2 šalice brašna, 3/4 šalice šećera, 1 prašak za pecivo, 1 vanilin šećer, 1 mala žličica soli, 1 jaje, 1 šalica mlijeka, 1/3 šalice ulja... Priprema: 1. brašno, šećer, prašak za pecivo, vanilin šećer i sol staviti u veću posudu i dobro promiješati sve te (suhe) sastojke 2. jaje, mlijeko i ulje staviti u manju posudu i dobro promiješati sve te (mokre) sastojke 3. pomiješati zajedno suhe i mokre sastojke 4. u lim za muffine staviti posudice od papira i u njih žlicom stavljati nadjev do pola pa onda staviti malo oraha ili pekmeza ili nutelle te prekriti sa još malo nadjeva da posudice budu skoro do kraja pune 5. peći na 200°C oko 15-20 min

Pregled novčanog tržišta

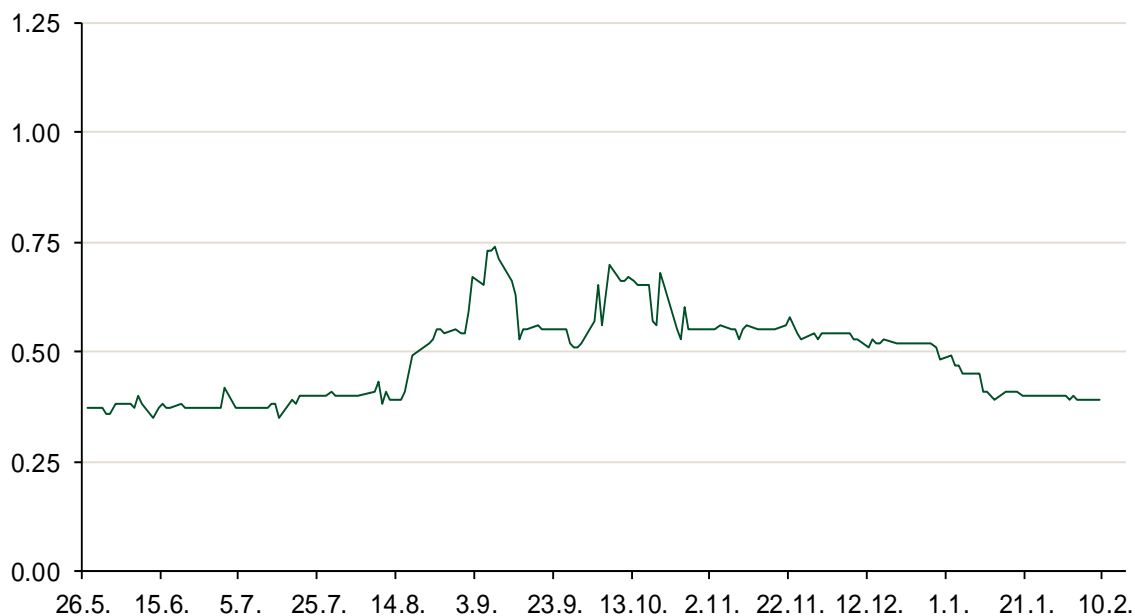
Referentne kamatne stope na dan 09.02.2017					Vrijednost udjela fondova 08.02.2017	
Opis	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	0.68667	-0.796	-	0.39	PBZ Novčani fond	143,4671 HRK
1W	0.71972	-0.796	-0.378	0.44	PBZ Euro novčani	139,3388 EUR
2W			-0.372	0.46	PBZ Dollar	132,6829 USD
1M	0.77167	-0.788	-0.371	0.53	PBZ Short term bond	102,6699 HRK
3M	1.03372	-0.726	-0.328	0.64	PBZ Bond	132,5672 EUR
6M	1.33794	-0.663	-0.241	0.76	PBZ Conservative 10	112,9549 EUR
1Y	1.70011	-0.510	-0.101	0.93	PBZ Flexible 30	101,3930 EUR
					PBZ Global	15,5498 EUR
					PBZ Equity	12,4588 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdavanja	Dat. Dospijeca
364	HRK	0.60	928	26.01.2017	25.01.2018
91	HRK	0.20	50	05.01.2017	06.04.2017
182	HRK	0.28	50	05.01.2017	06.07.2017
364	EUR/VK	0.17	29	27.10.2016	26.10.2017
455	EUR	0.70	1500	11.08.2016	09.11.2017

Kamatni sw apovi			
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.2300	1.2540	-0.7225
2 Y	-0.1430	1.5020	-0.6690
3 Y	-0.0620	1.6970	-0.5900
4 Y	0.0310	1.8520	-0.4890
5 Y	0.1396	1.9720	-0.3710
6 Y	0.2640	2.0740	-0.2590
7 Y	0.3849	2.1590	-0.1510
8 Y	0.5100	2.2300	-0.0460
9 Y	0.6390	2.2900	0.0510
10 Y	0.7296	2.3410	0.1370

PBZ Referente kamate						
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M	
Bid	0.00	0.00	0.00	0.15	0.25	
Ask	0.50	0.50	0.50	0.65	0.75	
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	110.60	111.30	1.48	1.24
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	114.90	115.60	1.49	1.27
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	120.60	121.30	2.43	2.31
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	119.00	119.70	2.88	2.79
HRK - Kunske						
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	104.25	104.75	0.75	0.13
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	105.90	106.40	1.00	0.66
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	115.30	116.30	1.59	1.29
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	103.00	104.00	2.03	1.80
RHMF-O-227A	2.250%	07.02.2022	100.60	101.10	2.12	2.02
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	112.00	113.00	2.88	2.74
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	112.00	113.00	2.84	2.72
RHMF-O-28CA	2.875%	07.02.2028	100.00	100.50	2.87	2.82

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	99.20	0.33
Francuska	92.68	1.04
Austrija	101.46	0.59
Italija	91.55	2.23
Španjolska	96.75	1.66
Portugal	90.72	4.08
Češka	104.69	0.49
Grčka	72.28	7.82
Slovenija	135.43	1.03

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
Republika Hrvatska						
CROATIA USD 2017	6.250%	27.04.2017	100.90	101.40	1.65	-0.80
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	108.10	108.60	0.07	-0.26
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	109.00	109.50	3.26	3.08
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	109.40	109.90	3.67	3.52
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	109.50	110.00	3.85	3.72
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	108.50	109.00	2.16	2.06
CROATIA USD 2023	5.5%	04.04.2023	106.70	107.20	4.25	4.16
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	109.70	110.20	4.37	4.29
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	100.15	100.65	2.98	2.91

CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	30	119	194
Italija	83	137	177
Spain	30	55	79

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	77.00	78.00	19.73	19.19
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	77.00	78.00	23.81	23.10
ZG. HOLDING 2023 HRK	3.875%	15.07.2023	102.50	104.00	3.43	3.17
HEP USD	6.000%	09.11.2017	102.70	104.20	2.25	0.25
HEP USD	5.875%	23.10.2022	105.40	106.40	4.78	4.58

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

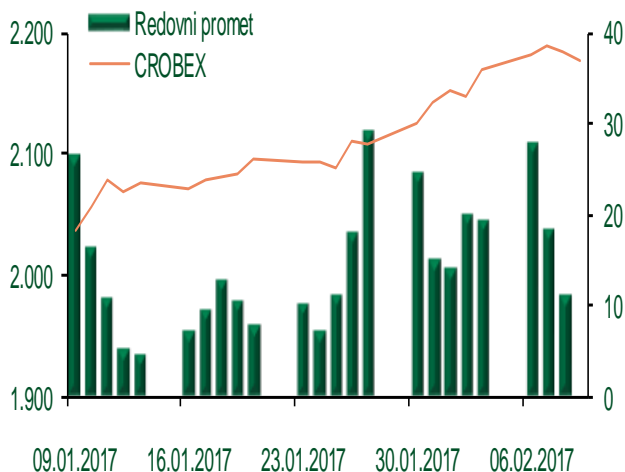
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 09.02.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	11.173,79
Redovni promet ('000 HRK)	11.173,79
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	42.886,47
Vrijednost CROBEX indeksa	2.176,26
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,38%
Promjena CROBEX indeksa u 2017.	9,09%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.248,59
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,38%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2017.	7,81%

Izvor: Zagrebačka burza

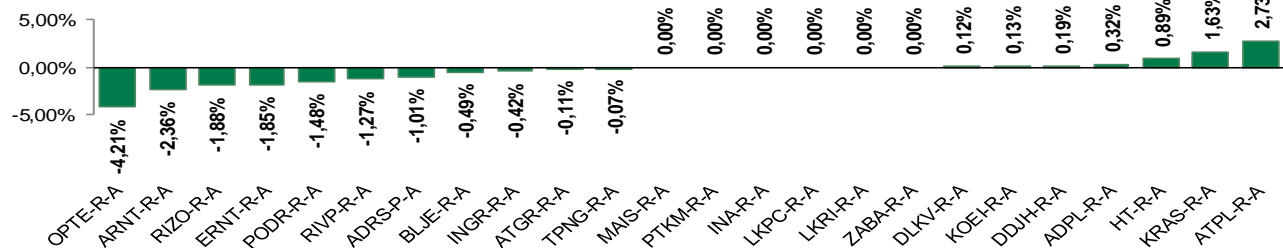
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 09.02.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	41,99	-1,27%	20,45%	1.726,06	5.291,90
OPTE-R-A	OT-optima telekom d.d.	3,87	-4,21%	43,87%	1.552,60	10,91
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	175,45	0,89%	3,82%	1.047,73	14.367,34
JMNC-R-A	Jamnica d.d.	141.000,00	-0,70%	0,71%	987,99	3.119,77
PODR-R-A	Podravka d.d.	405,00	-1,48%	7,28%	746,81	2.195,10

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 09.02.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	705,26	0,80%	-1,69%
BELEXline	1.537,36	0,41%	-2,04%
SBI TOP	750,24	-0,58%	4,55%
SASX-10	660,72	0,15%	-4,31%
BIRS	544,80	0,24%	-0,34%
MONEX 20	11.398,55	-0,53%	-0,97%
MBI-10	2.292,76	0,00%	7,39%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 09.02.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7229,5	+0,57%	1,21%
DAX 30	11642,86	+0,86%	1,41%
CAC 40	4826,24	+1,25%	-0,74%
DJIA	20172,4	+0,59%	2,07%
NASDAQ	5715,18	+0,58%	6,17%
S&P 500	2307,87	+0,58%	3,08%
NIKKEI 225	19378,93	+2,49%	1,38%

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.