

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

10. listopada 2017.

- volatilnost tečaja EURHRK
- trenutna razina tečaja 7,50
- CROBEX u laganom padu
- dolarov indeks sličan razini zatvaranja u petak
- EURUSD na razini 1,1772
- USDJPY na razini 112,68

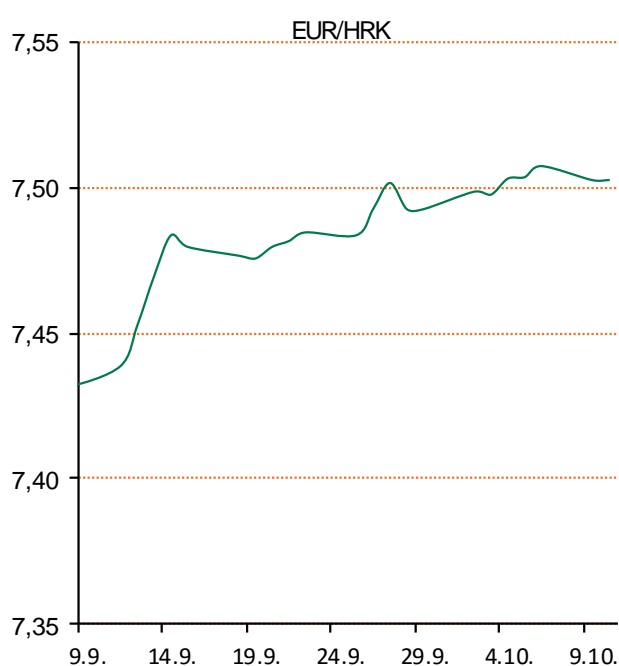
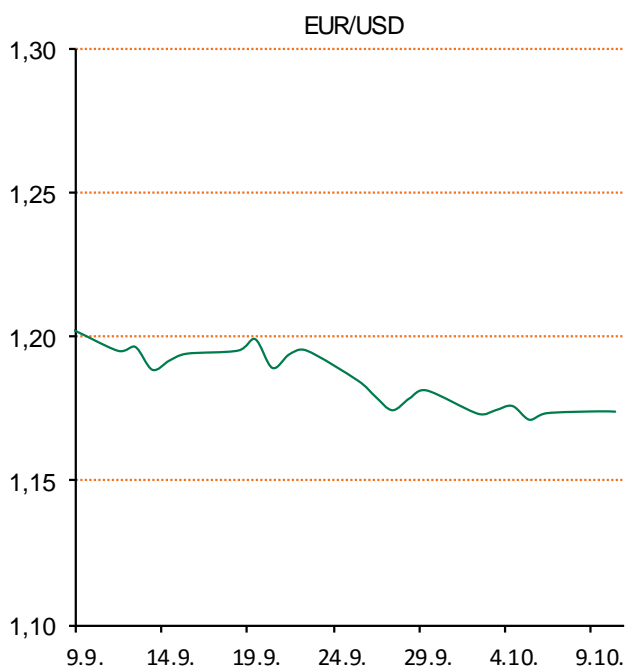
Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,1769	1,1772	O/N	0,5	1,4	1Y	-0,2578	-0,2484
EURCHF	1,1516	1,1521	T/N	0,5	1,4	2Y	-0,174	-0,169
EURGBP	0,8939	0,8943	1W	3	10	3Y	-0,048	-0,043
EURJPY	132,54	132,59	2W	5	22	4Y	0,09	0,1
GBPUSD	1,3163	1,3166	1M	12	52	5Y	0,234	0,242
USDJPY	112,62	112,63	3M	9	153	7Y	0,512	0,522
GOLD	1287,08	1287,20	6M	19	341	9Y	0,77	0,78
BRENT	55,38	55,40	12M	38	761	10Y	0,8641	0,9141

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4800	7,5300
USDHRK	6,3541	6,3982
CHFHRK	6,4925	6,5387
GBPHRK	8,3641	8,4238
JPYHRK	5,6415	5,6813
AUDHRK	4,9425	4,9765
CADHRK	5,0726	5,1082
NOKHRK	0,7961	0,8018
DKKHRK	1,0049	1,0117
SEKHRK	0,7841	0,7896
HUFHRK	2,4007	2,4177
PLNHRK	1,7381	1,7503
CZKHRK	0,2889	0,2910

Dobro jutro. Jučer smo dan započeli na razini 7,50EURHRK. Tokom dana tečaj je bio dosta volatiln, čak se spustio na razinu od 7,498. Krajem dana tečaj se vratio u početnu razinu od 7,50. Ključni dionički indeksi Zagrebačke burze su nakon porasta u petak ponovno umanjeni. CROBEX je pao za 0,12% na 1.811,06 bodova, a CROBEX10 za 0,09% na 1.072,00 boda.

Dolar se u ponedjeljak na međunarodnim tržištima zadržao nedaleko najviših razina u posljednjih deset tjedana prema košarici najvažnijih svjetskih valuta, a trgovanje je bilo mirno zbog praznika u mnogim zemljama. Dolarov indeks, koji mjeri vrijednost američke prema ostalih šest najznačajnijih svjetskih valuta, jutros je iznosio 93,789 bodova, vrlo blizu razinama na zatvaranju trgovanja u petak, i drži se nedaleko 94,267 bodova, najviše razine od kraja srpnja. Pritom je tečaj američke valute prema japanskoj ostao više-manje nepromijenjen, na 112,68 jena. Eurom se u takvom ozračju trgovalo po uglavnom nepromijenjenom tečaju u usporedbi sa zatvaranjem trgovanja u petak, po 1,1726 dolara. Trenutno EURUSD je na razini od 1,1772.



Film The Snow man - Dolaskom jeseni u grad, vraća se strah od misterioznih ubojstava koja se ponavljaju svake zime u zadnjem desetljeću. Detektiv Hole (Michael Fassbender) u Snjegoviću pokušava stati na kraj serijskom ubojici čije žrtve uvijek nestaju na dan kad u Oslu padne prvi snijeg. Uz pomoć mlade talentirane kolegice (Rebecca Ferguson), desetljeće stare slučajeve povezuju s novim ubojstvom te otkrivaju da za hvatanje ubojice imaju vremena samo do prvog sljedećeg snijega.

Pregled novčanog tržišta

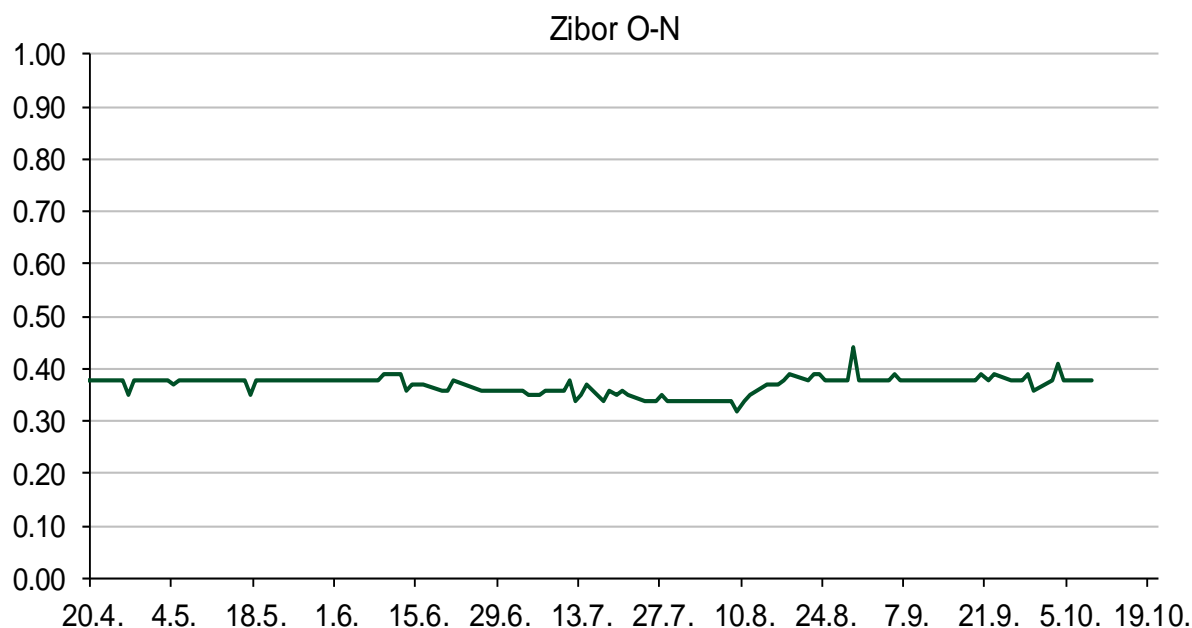
Opis	Referentne kamatne stope na dan			09.10.2017	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	1.18222	-0.781	-	0.38	
1W	1.20222	-0.791	-0.379	0.40	
2W			-0.377	0.49	
1M	1.235	-0.783	-0.373	0.52	
3M	1.35028	-0.726	-0.329	0.59	
6M	1.51878	-0.649	-0.274	0.67	
1Y	1.80456	-0.511	-0.176	0.79	

Fond	Vrijednost udjela fondova	
	06.10.2017	
PBZ Novčani fond	143,5038	HRK
PBZ Euro novčani	128,7551	EUR
PBZ Dollar	133,5045	USD
PBZ Short term bond	104,0948	HRK
PBZ Bond	135,9945	EUR
PBZ Conservative 10	116,4483	EUR
PBZ Flexible 30	104,3093	EUR
PBZ Global	15,5380	EUR
PBZ Equity	11,7238	EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdavanja	Dat. Dospjeća
91	HRK	0.20	50	05.01.2017	06.04.2017
182	HRK	0.25	20	24.08.2017	22.02.2018
364	HRK	0.40	402.00	31.08.2017	30.08.2018
364	EUR/VK	0.01	31	31.08.2017	30.08.2018
455	EUR	0.70	1500	11.08.2016	09.11.2017

	Kamatni sw apovi		
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.2725	1.6050	-0.6650
2 Y	-0.1875	1.7760	-0.5480
3 Y	-0.0661	1.8910	-0.4542
4 Y	0.0890	1.9760	-0.3160
5 Y	0.2340	2.0480	-0.2040
6 Y	0.3740	2.1140	-0.0970
7 Y	0.5120	2.1750	0.0050
8 Y	0.6390	2.2290	0.1020
9 Y	0.7625	2.2790	0.1940
10 Y	0.8840	2.3220	0.2730

PBZ Referente kamate						
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M	
Bid	0.00	0.00	0.00	0.10	0.20	
Ask	0.40	0.40	0.50	0.60	0.70	
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	



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	110.40	111.10	0.46	0.15
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	114.25	114.95	0.51	0.24
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	122.45	123.15	1.60	1.46
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	122.40	123.10	2.16	2.06
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	100.95	101.15	-1.64	-3.25
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	103.90	104.40	0.01	-0.63
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	114.00	115.00	0.84	0.45
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	104.95	105.95	1.39	1.12
RHMF-O-227A	2.250%	07.02.2022	103.00	103.50	1.53	1.41
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	114.95	115.95	2.37	2.23
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	113.70	114.70	2.56	2.44
RHMF-O-28CA	2.875%	07.02.2028	101.00	101.50	2.76	2.71
RHMF-O-32CA	3.250%	07.07.2032	102.00	103.00	3.08	3.00

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	100.50	0.45
Francuska	98.67	0.88
Austrija	98.72	0.64
Italija	98.95	2.18
Španjolska	97.90	1.68
Portugal	114.24	2.43
Češka	90.57	1.33
Grčka	87.29	5.61
Slovenija	102.61	0.96

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	104.30	104.50	0.06	-0.20
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.25	108.75	2.62	2.38
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	109.90	110.40	2.86	2.68
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	110.80	111.30	3.05	2.91
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	112.70	113.20	1.05	0.95
CROATIA USD 2023	5.500%	04.04.2023	110.80	111.30	3.33	3.23
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	114.00	114.50	3.50	3.42
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	107.50	108.00	1.90	1.83
CROATIA EUR 2027	3.000%	20.03.2027	105.00	105.50	2.40	2.34

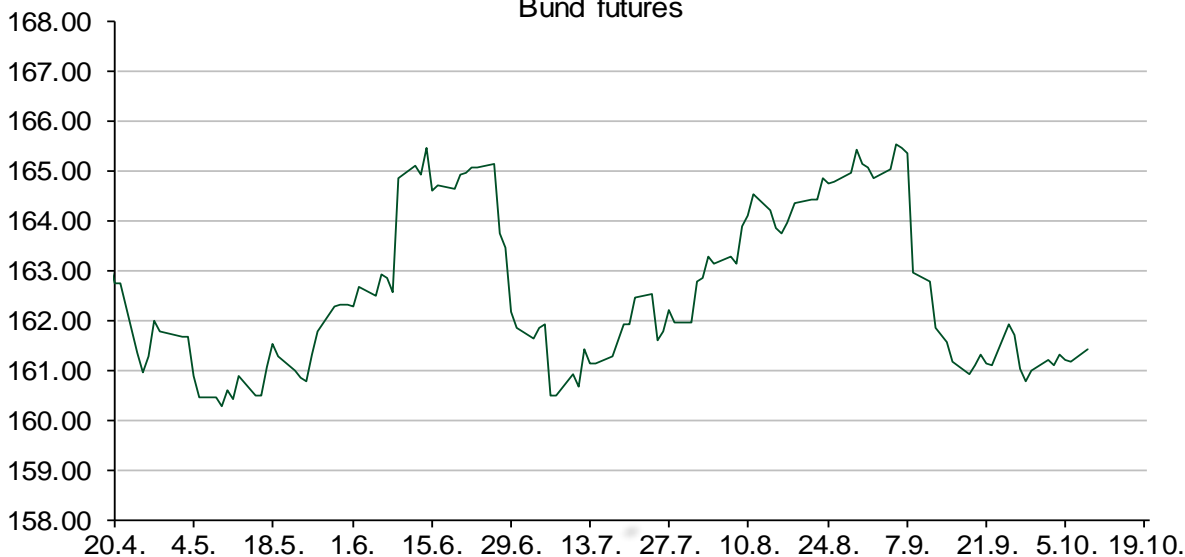
CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	19	59	102
Italija	43	101	142
Spain	20	46	69

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	30.00	31.00	80.04	77.73
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	31.00	32.00	114.08	110.59
ZG. HOLDING 2023 HRK	3.875%	15.07.2023	102.00	103.50	3.48	3.20
HEP USD	6.000%	09.11.2017	100.40	100.90	0.72	-5.63
HEP USD	5.875%	23.10.2022	111.25	112.25	3.42	3.22

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

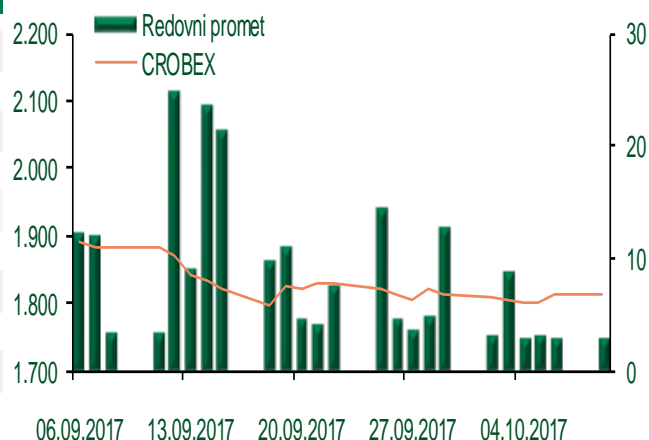
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 09.10.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	2.969,75
Redovni promet ('000 HRK)	2.969,75
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	0,00
Vrijednost CROBEX indeksa	1.811,06
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,12%
Promjena CROBEX indeksa u 2017.	-9,21%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.072,00
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,09%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2017.	-7,44%

Izvor: Zagrebačka burza

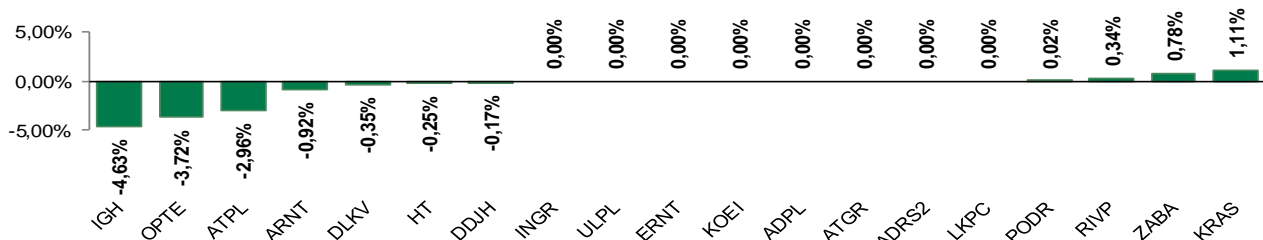
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 09.10.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
PODR	Podravka prehrambena industrija d.d.	294,00	0,02%	-22,12%	940,50	2.093,28
RVP	Valamar Riviera d.d.	43,82	0,34%	25,70%	710,83	5.522,53
HT	Hrvatski Telekom d.d.	173,56	-0,25%	2,70%	577,31	14.212,57
ATPL	Atlantska plovidba d.d.	417,00	-2,96%	47,58%	95,09	581,93
DDJH	Đuro Đaković Grupa d.d.	35,45	-0,17%	-22,93%	94,65	269,30

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 09.10.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	727,11	0,14%	1,36%
BELEXline	1.619,65	0,17%	3,20%
SBI TOP	810,78	1,38%	12,99%
SASX-10	629,16	-0,18%	-8,88%
BIRS	559,21	0,03%	2,29%
MONEX 20	10.829,07	0,48%	-5,92%
MBI-10	2.640,56	0,00%	23,68%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 09.10.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7507,89	-0,20%	5,11%
DAX 30	12976,4	+0,16%	13,02%
CAC 40	5365,83	+0,11%	10,36%
DJIA	22761,07	-0,06%	15,17%
NASDAQ	6579,73	-0,16%	22,23%
S&P 500	2544,73	-0,18%	13,66%
NIKKEI 225	20823,51	+0,64%	8,94%

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.