

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

11. listopada 2017.

- letargično trgovanje tokom jučerašnjeg dana na domaćem deviznom tržištu
- EURHRK se kretala oko razine 7.50
- interval kretanja domaćeg valutnog para za danas vidimo unutar 7.48 – 7.53
- \$ izgubio na svojoj vrijednosti kontra košarice valuta
- indeks ekonomskog raspoloženja pao u rujnu
- od današnjih važnijih podataka za \$: MBA Mortgage Applications (13 h) i PPI Final Demand (14:30 h)
- CROBEX u porastu

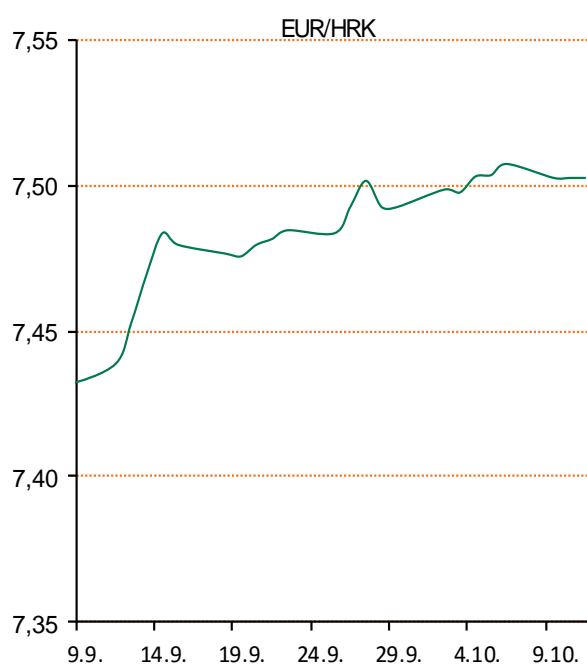
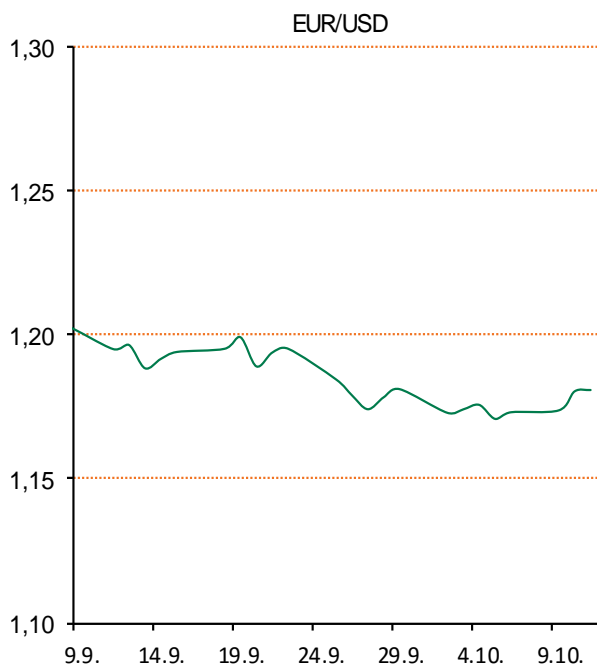
Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,1828	1,1831	O/N	0,5	1,3	1Y	-0,28	-0,24
EURCHF	1,1526	1,1529	T/N	0,5	1,3	2Y	-0,18	-0,15
EURGBP	0,8958	0,8962	1W	3	10	3Y	-0,06	-0,02
EURJPY	132,80	132,83	2W	5	20	4Y	0,09	0,11
GBPUSD	1,3201	1,3205	1M	13	52	5Y	0,23	0,25
USDJPY	112,26	112,29	3M	9	153	7Y	0,51	0,53
GOLD	1289,64	1289,78	6M	19	341	9Y	0,775	0,785
BRENT	56,41	56,43	12M	38	761	10Y	0,89	0,9

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4800	7,5300
USDHRK	6,3224	6,3662
CHFHRK	6,4880	6,5331
GBPHRK	8,3464	8,4059
JPYHRK	5,6313	5,6702
AUDHRK	4,9246	4,9585
CADHRK	5,0537	5,0889
NOKHRK	0,7967	0,8025
DKKHRK	1,0050	1,0118
SEKHRK	0,7848	0,7904
HUFHRK	2,4122	2,4306
PLNHRK	1,7452	1,7572
CZKHRK	0,2888	0,2909

Na domaćem deviznom tržištu zabilježili smo letargično trgovanje bez velikih promjena, tečaj EUR/HRK se kretao na razinama unutar 7,500-7,505 kuna za euro. Ponuda i potražnja za devizama na međubankarskom tržištu su bile međusobno uravnotežene, dok je od strane korporativnih klijenata bilo izuzetno mirno, gotovo bez trgovanja. Današnje trgovanje vidimo unutar intervala 7,48-7,53.

Američki dolar je pao u odnosu na ostale valute nakon što su objavljeni podaci koji su pokazali da je indeks ekonomskog raspoloženja u SAD-u pao u rujnu. Podaci su pokazali da je IBD/TIPP indeks ekonomskog raspoloženja pao u rujnu na 50,3 bodova sa 53,4 u prethodnom mjesecu, a analitičari su prognozirali rast na 54,2 bodova. EUR/USD je u takvim okolnostima porastao na 1,1819. Američka valuta je pala u odnosu na japanski jen, funtu i švicarski franak. USD/JPY se spustio na 112,39, GBP/USD je porastao na 1,3196, a USD/CHF je pao na 0,9752.



Sport: Hrvatska će na ždrijebu u Zurichu biti nositelj zahvaljujući FIFA-inoj ljestvici te neće moći igrati protiv Švicarske, Italije i Danske. Potencijalni suparnici tim reprezentacijama su Grčka, Švedska, Irska i Sjeverna Irska.

Pregled novčanog tržišta

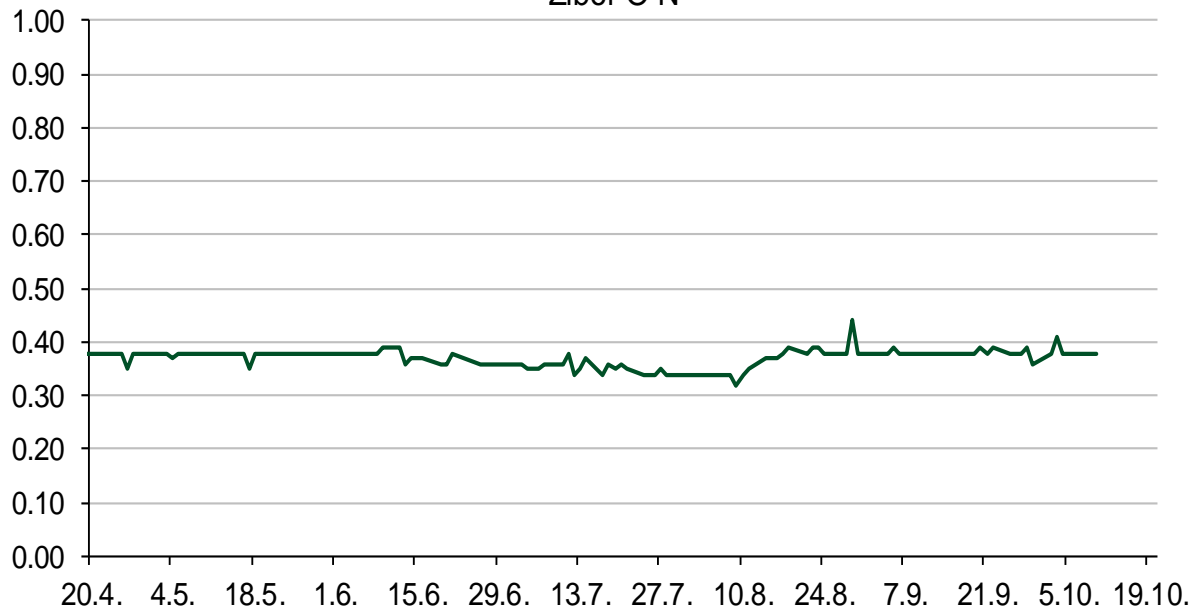
Referentne kamatne stope na dan					Vrijednost udjela fondova	
Opis	10.10.2017			09.10.2017		
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	1.18222	-0.783	-	0.38	PBZ Novčani fond	143,5033 HRK
1W	1.20333	-0.793	-0.379	0.40	PBZ Euro novčani	128,7545 EUR
2W			-0.377	0.48	PBZ Dollar	133,5058 USD
1M	1.23722	-0.783	-0.371	0.52	PBZ Short term bond	104,1080 HRK
3M	1.35639	-0.726	-0.329	0.59	PBZ Bond	135,9441 EUR
6M	1.52489	-0.649	-0.274	0.67	PBZ Conservative 10	116,4286 EUR
1Y	1.809	-0.511	-0.181	0.79	PBZ Flexible 30	104,2344 EUR
					PBZ Global	15,5436 EUR
					PBZ Equity	11,7395 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financijska RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	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 swapovi			
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.2759	1.6070	-0.6575
2 Y	-0.1720	1.7750	-0.5380
3 Y	-0.0450	1.8860	-0.4442
4 Y	0.0980	1.9680	-0.3070
5 Y	0.2460	2.0390	-0.1930
6 Y	0.3900	2.1050	-0.0860
7 Y	0.5280	2.1670	0.0180
8 Y	0.6600	2.2210	0.1150
9 Y	0.7860	2.2710	0.2070
10 Y	0.9020	2.3140	0.2920

PBZ Referentne 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	

Zibor 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	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	-1.82	-3.47
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	103.90	104.40	-0.01	-0.66
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	114.00	115.00	0.83	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	100.33	0.47
Francuska	98.56	0.89
Austrija	98.56	0.66
Italija	98.89	2.19
Španjolska	97.99	1.67
Portugal	114.54	2.39
Češka	90.20	1.38
Grčka	87.41	5.59
Slovenija	102.34	0.99

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	0.04	-0.22
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.25	108.75	2.61	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

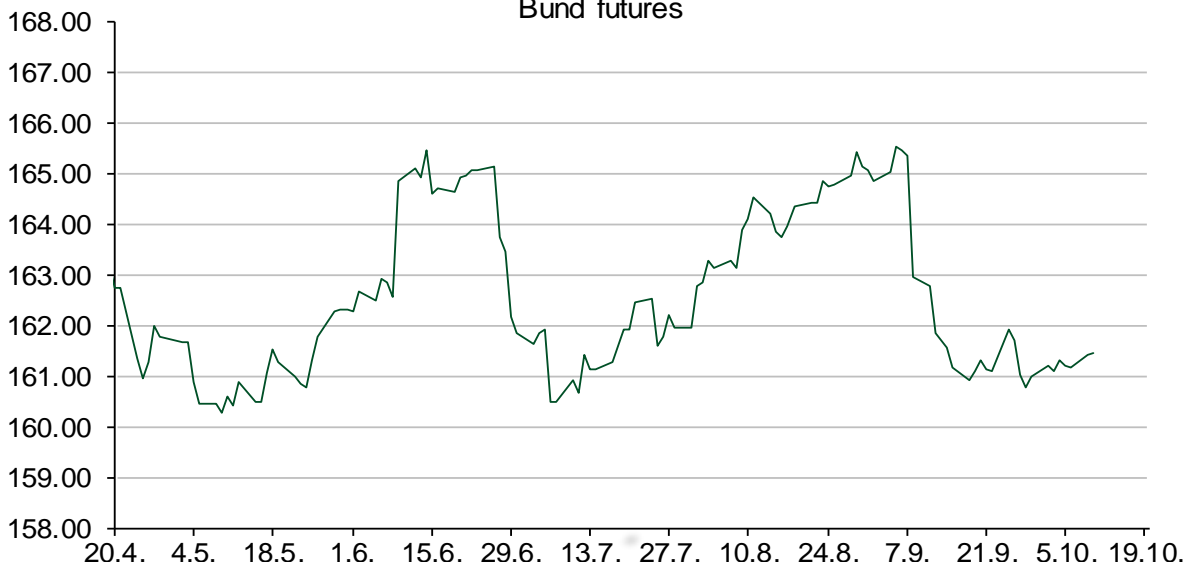
CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	19	58	102
Italija	45	104	142
Spain	20	46	70

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	30.00	31.00	80.12	77.80
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	31.00	32.00	114.29	110.79
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	0.53	-6.06
HEP USD	5.875%	23.10.2022	111.25	112.25	3.42	3.22

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

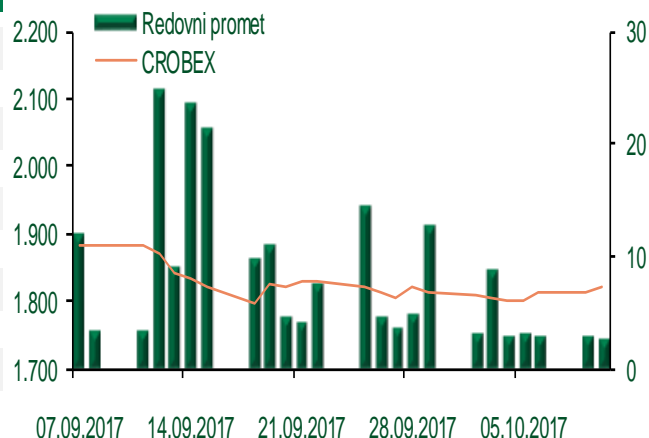
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 10.10.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	2.794,77
Redovni promet ('000 HRK)	2.794,77
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	27.236,38
Vrijednost CROBEX indeksa	1.820,66
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,53%
Promjena CROBEX indeksa u 2017.	-8,73%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.074,79
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,26%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2017.	-7,20%

Izvor: Zagrebačka burza

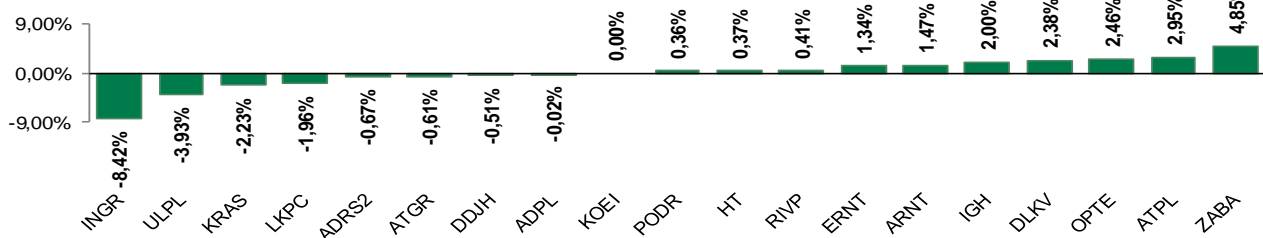
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 10.10.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
RVP	Valamar Riviera d.d.	44,00	0,41%	26,22%	729,10	5.545,21
ZABA	Zagrebačka banka d.d.	54,00	4,85%	0,00%	341,72	17.293,07
HT	Hrvatski Telekom d.d.	174,20	0,37%	3,08%	341,47	14.264,98
HUPZ	HUP- Zagreb d.d.	3.270,00	2,19%	16,83%	221,85	1.412,61
MDKA	Medika d.d.	15.400,00	2,43%	-12,00%	165,49	464,99

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 10.10.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	727,23	0,02%	1,37%
BELEXline	1.620,26	0,04%	3,24%
SBI TOP	812,39	0,20%	13,21%
SASX-10	629,09	-0,01%	-8,89%
BIRS	559,36	0,03%	2,32%
MONEX 20	10.901,60	0,67%	-5,29%
MBI-10	2.647,35	0,26%	24,00%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 10.10.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7538,27	+0,40%	5,54%
DAX 30	12949,25	-0,21%	12,79%
CAC 40	5363,65	-0,04%	10,31%
DJIA	22830,68	+0,31%	15,52%
NASDAQ	6587,25	+0,11%	22,37%
S&P 500	2550,64	+0,23%	13,93%
NIKKEI 225	20881,27	+0,28%	9,24%

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.