

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

26. srpanj 2017.

- Mirno na domaćem deviznom tržištu
- EUR/HRK unutar 7,39 – 7,44
- EUR/USD iznad 1,16
- CROBEX bez značajne promjene, europski i američki dionički indeksi u porastu

Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,1633	1,1636
EURCHF	1,1083	1,1086
EURGBP	0,8936	0,8939
EURJPY	130,11	130,16
GBPUSD	1,3018	1,3019
USDJPY	111,83	111,88
GOLD	1245,40	1246,15
BRENT	49,13	49,15

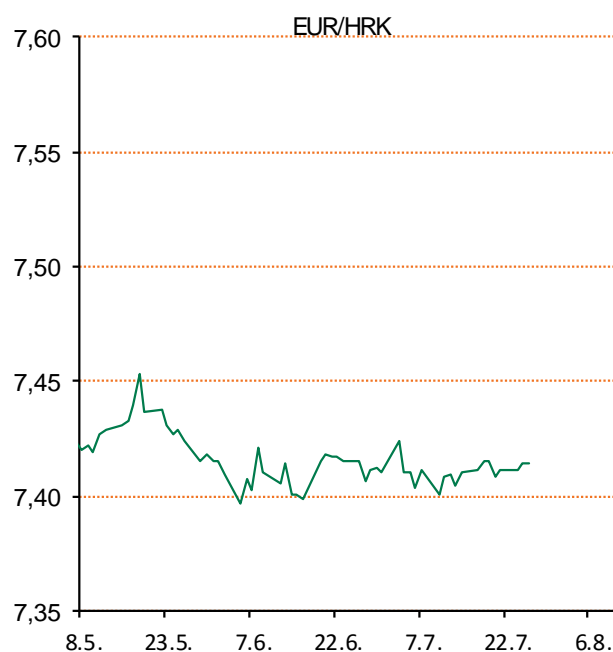
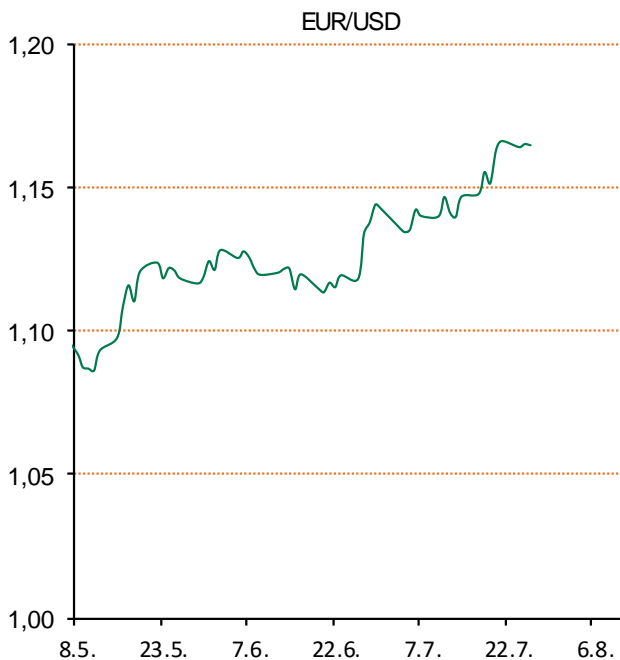
	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	-0,1	0,9
T/N	0,2	0,9
1W	-1	7
2W	0	16
1M	0	36
3M	0	133
6M	19	300
12M	150	751

	Interest rate swap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,26	-0,23
2Y	-0,17	-0,14
3Y	-0,04	-0,01
4Y	0,105	0,135
5Y	0,268	0,278
7Y	0,553	0,563
9Y	0,813	0,823
10Y	0,91	0,96

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,3900	7,4400
USDHRK	6,3510	6,3956
CHFHRK	6,6661	6,7130
GBPHRK	8,2671	8,3259
JPYHRK	5,6776	5,7182
AUDHRK	5,0160	5,0513
CADHRK	5,0783	5,1145
NOKHRK	0,7948	0,8006
DKKHRK	0,9937	1,0005
SEKHRK	0,7726	0,7782
HUFHRK	2,4199	2,4370
PLNHRK	1,7352	1,7482
CZKHRK	0,2840	0,2860

Utorak je na domaćem deviznom tržištu donio nastavak blažih deprecijacijskih pritisaka na kunu u odnosu na jedinstvenu europsku valutu. Tečaj EUR/HRK porastao je s razine 7,407 na 7,410 kuna za euro potaknut velikom ponudom za devizama prvenstveno od strane bankarskog sektora. Pred kraj dana tečaj je nastavio u tom smjeru te smo zatvorili na 7,413 kuna za euro uslijed povećanje potražnje od strane tržišnih sudionika. Današnje trgovanje vidimo unutar intervala 7,39 – 7,44.

Tečaj dolara u utorak je na međunarodnim tržištima skliznuo na nove najniže razine u 13 mjeseci u odnosu na košaricu najvažnijih svjetskih valuta dok ulagači nove smjernice čekaju sa sjednice američke središnje banke Fed. Dolarov indeks, koji mjeri vrijednost američke prema drugih šest najznačajnijih svjetskih valuta, jutros je skliznuo na 93,815 bodova, najnižu razinu od lipnja 2016. godine. U proteklih je mjesec dana oslabio gotovo četiri posto, a od početka godine više od osam posto.



Sport: Hrvatska vaterpolo reprezentacija u utorak navečer plasirala se u polufinale Svjetskog prvenstva koje se održava u Budimpešti. Barakude su sjajnom igrom pobijedile najpriljaviju momčad svijeta Italiju rezultatom 12-9. Junaci pobjede bili su 'hrvatski vaterpolski Messi' Sandro Sukno i Javi Garcia.

Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamatne stope na dan			25.07.2017	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	1.17889	-0.782	-	0.34	
1W	1.19444	-0.797	-0.379	0.42	
2W			-0.377	0.48	
1M	1.23278	-0.784	-0.371	0.52	
3M	1.31389	-0.729	-0.329	0.60	
6M	1.45278	-0.652	-0.272	0.68	
1Y	1.73567	-0.503	-0.153	0.79	

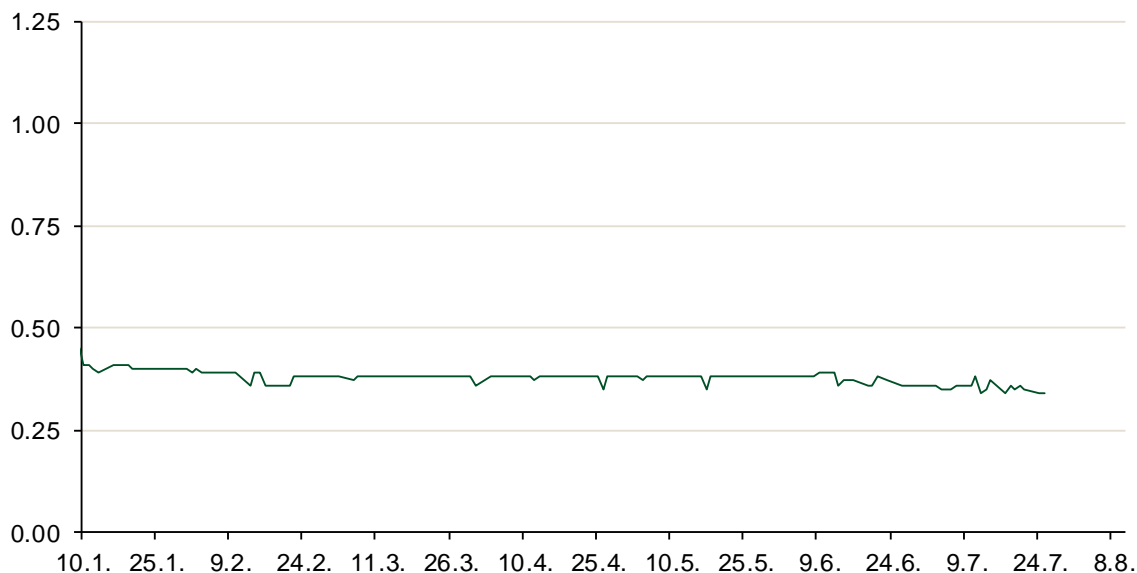
Vrijednost udjela fondova		22.07.2017
Fond		
PBZ Novčani fond		143,4770 HRK
PBZ Euro novčani		128,7554 EUR
PBZ Dollar		133,2233 USD
PBZ Short term bond		103,1200 HRK
PBZ Bond		134,4342 EUR
PBZ Conservative 10		114,8724 EUR
PBZ Flexible 30		103,4013 EUR
PBZ Global		15,2612 EUR
PBZ Equity		12,0332 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospijeća
364	HRK	0.45	646	28.06.2017	28.06.2018
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 swapovi			
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.2520	1.4770	-0.6675
2 Y	-0.1620	1.6280	-0.5570
3 Y	-0.0300	1.7510	-0.4390
4 Y	0.1190	1.8550	-0.3160
5 Y	0.2720	1.9490	-0.1920
6 Y	0.4103	2.0310	-0.0840
7 Y	0.5496	2.1060	0.0250
8 Y	0.6835	2.1720	0.1260
9 Y	0.8094	2.2290	0.2190
10 Y	0.9310	2.2810	0.3100

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 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	110.00	110.70	1.05	0.76
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	113.65	114.35	1.18	0.93
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	121.50	122.20	1.96	1.83
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	120.50	121.20	2.52	2.42
HRK - Kunske						
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	102.00	102.20	0.26	-0.32
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	104.55	105.05	0.49	-0.01
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	114.00	115.00	1.29	0.93
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	103.40	104.40	1.85	1.60
RHMF-O-227A	2.250%	07.02.2022	100.40	100.90	2.16	2.04
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	113.10	114.10	2.66	2.52
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	111.40	112.40	2.86	2.73
RHMF-O-28CA	2.875%	07.02.2028	97.95	98.45	3.10	3.05

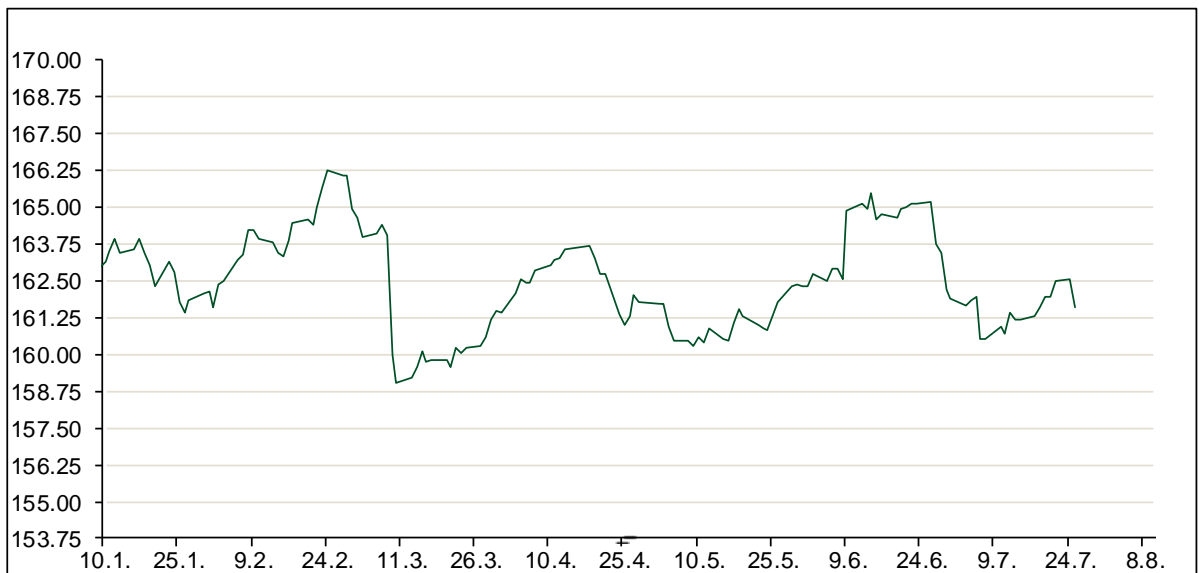
Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina		
Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	99.50	0.55
Francuska	101.92	0.80
Austrija	98.02	0.71
Italija	100.95	2.10
Španjolska	99.87	1.52
Portugal	109.79	2.95
Češka	93.52	0.96
Grčka	88.98	5.31
Slovenija	100.82	1.16

Eurobonds Rep. Hrvatske						
Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
Republika Hrvatska						
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	105.50	105.70	0.12	-0.08
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.80	109.30	2.74	2.52
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	110.45	110.95	2.93	2.76
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	111.30	111.80	3.09	2.95
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	110.90	111.40	1.52	1.42
CROATIA USD 2023	5.500%	04.04.2023.	110.55	111.05	3.44	3.35
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	113.70	114.20	3.62	3.54
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	104.00	104.50	2.42	2.35
CROATIA EUR 2027	3.000%	20.03.2027	101.95	102.45	2.77	2.71

CDS Pregled			
Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	31	79	138
Italija	38	98	134
Spain	16	40	63

Hrvatske korporativne obveznice						
AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	15.00	16.00	126.62	121.12
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	15.00	16.00	178.79	170.91
ZG. HOLDING 2023 HRK	3.875%	15.07.2023	102.00	103.50	3.50	3.22
HEP USD	6.000%	09.11.2017	101.00	102.00	2.50	-0.85
HEP USD	5.875%	23.10.2022	108.75	109.75	4.01	3.81

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

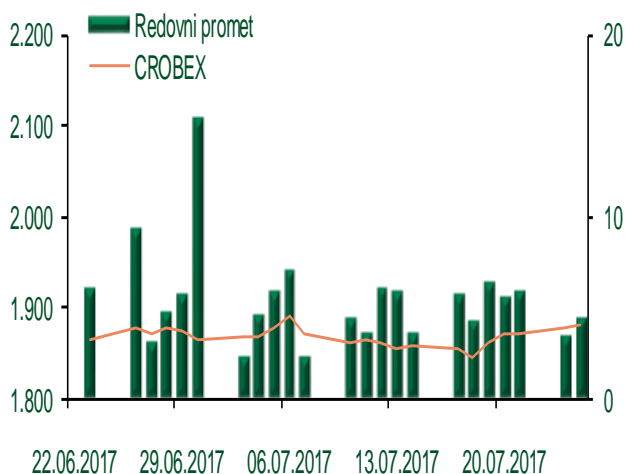
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 25.07.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	8.976,98
Redovni promet ('000 HRK)	4.376,98
Prijavljeni promet ('000 HRK)	4.600,00
OTC promet ('000 HRK)	19.113,01
Vrijednost CROBEX indeksa	1.879,39
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,04%
Promjena CROBEX indeksa u 2017.	-5,79%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.115,21
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,20%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2017.	-3,71%

Izvor: Zagrebačka burza

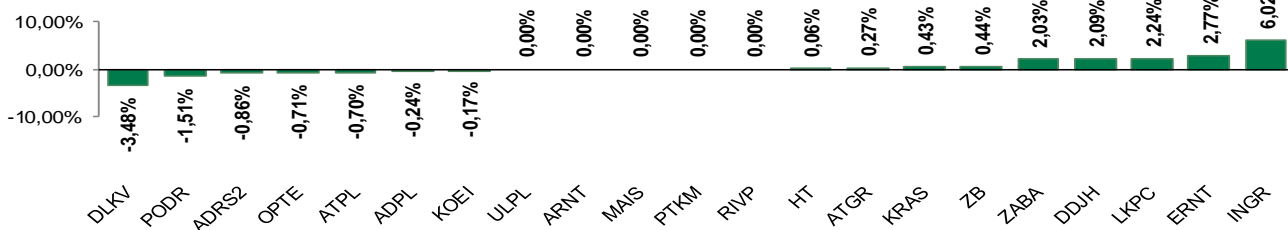
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 25.07.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
RVP	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	44,00	0,00%	26,22%	1.493,53	5.545,21
HT	Hrvatski Telekom d.d.	180,00	0,06%	6,51%	615,27	14.739,94
ATGR	Atlantic grupa d.d.	790,00	0,27%	-10,43%	493,38	2.634,10
DLKV	Dalekovod d.d.	22,20	-3,48%	65,80%	195,70	50,92
ERNT	Ericsson Nikola Tesla d.d.	1.223,99	2,77%	5,15%	191,82	1.629,93

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 25.07.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	718,50	0,05%	0,16%
BELEXline	1.552,33	0,19%	-1,09%
SBI TOP	808,80	0,51%	12,71%
SASX-10	618,71	0,00%	-10,39%
BIRS	564,17	0,27%	3,20%
MONEX 20	10.945,91	-1,30%	-4,91%
MBI-10	2.570,82	-0,25%	20,42%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 25.07.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7434,82	+0,77%	4,09%
DAX 30	12264,31	+0,45%	6,82%
CAC 40	5161,08	+0,65%	6,14%
DJIA	21613,43	+0,47%	9,37%
NASDAQ	6412,17	+0,02%	19,12%
S&P 500	2477,13	+0,29%	10,64%
NIKKEI 225	20050,16	+0,48%	4,90%

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.