

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

27. listopada 2017.

- jučerašnji dan na domaćem terenu u znaku vrlo ujednačene ponude i potražnje
- očekivani interval kretanja EURHRK u današnjem danu unutar 7.49 – 7.54
- tečaj jedinstvene europske valute se od jutra kreće oko 1.1620 kontra \$
- euro i dalje pod pritiskom nakon odluka čelnika ECB-a na redovitoj sjednici
- cijena Brenta se trenutno kreće oko \$59 po barelu
- dolarov indeks pao za 0,1%
- CROBEX u porastu

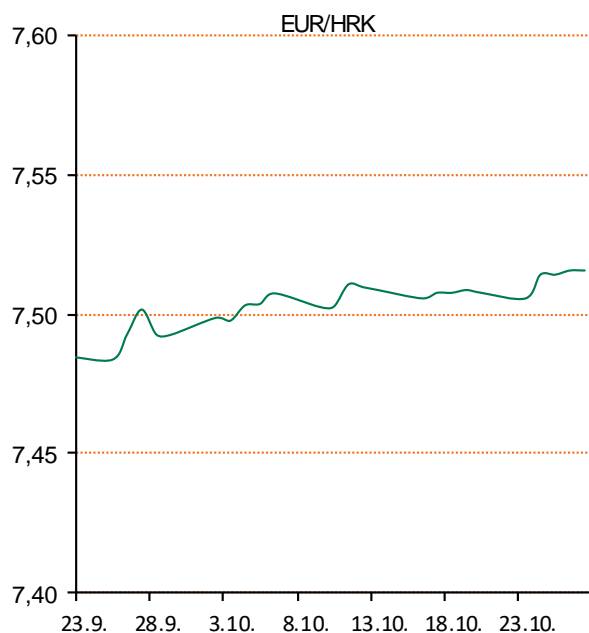
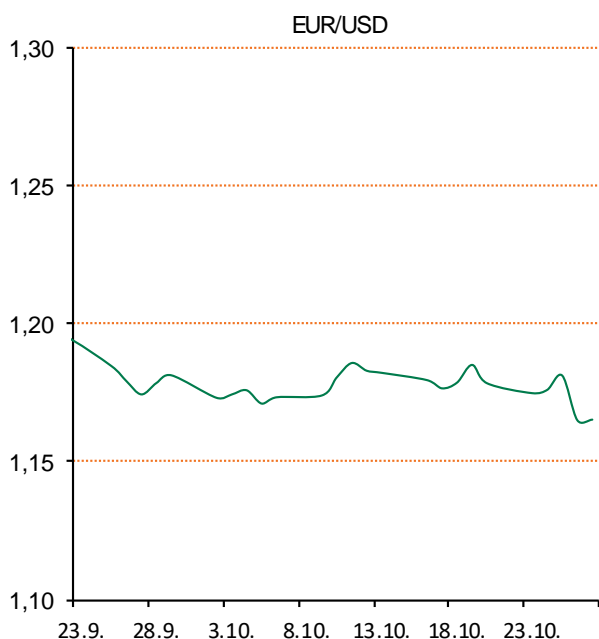
Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,1616	1,1620	O/N	1,6	3,8	1Y	-0,267	-0,261
EURCHF	1,1612	1,1613	T/N	0,5	1,3	2Y	-0,197	-0,187
EURGBP	0,8863	0,8866	1W	3	10	3Y	-0,088	-0,048
EURJPY	132,72	132,76	2W	5	21	4Y	0,0655	0,0855
GBPUSD	1,3106	1,311	1M	13	52	5Y	0,2163	0,2263
USDJPY	114,24	114,27	3M	9	154	7Y	0,4985	0,5185
GOLD	1265,14	1265,24	6M	38	342	9Y	0,7623	0,7823
BRENT	59,04	59,06	12M	76	762	10Y	0,868	0,909

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4900	7,5400
USDHRK	6,4458	6,4910
CHFHRK	6,4497	6,4933
GBPHRK	8,4480	8,5073
JPYHRK	5,6418	5,6811
AUDHRK	4,9241	4,9579
CADHRK	5,0033	5,0384
NOKHRK	0,7876	0,7930
DKKHRK	1,0063	1,0131
SEKHRK	0,7704	0,7759
HUFHRK	2,4041	2,4215
PLNHRK	1,7594	1,7717
CZKHRK	0,2918	0,2940

Dobro jutro! Četvrtak je na domaćem deviznom tržištu protekao jako mirno, bez promjena. Najpoznatiji domaći valutni par EUR/HRK zadržao je razinu 7.512. Današnje trgovanje očekujemo u intervalu 7.49 – 7.54. Ključni dionički indeksi ZSE-a su trgovanje zaključili rastom. CROBEX je uvećan za 0.83 posto na 1.899,11 bodova. Ukupni promet na ZSE - Zagrebačkoj burzi iznosio je 9.1 milijun kuna.

Strano devizno tržište u znaku EUR koji se prema USD zadržao blizu najviših razina u tjedan dana. Razlog je sjednica ECB-a i očekivanja smjernica u vezi daljnjih poteza u monetarnoj politici. Euro je ojačao 0.1 posto prema dolaru, na 1.1825. Tečaj dolara u odnosu na jen ostao je gotovo nepromijenjen u odnosu na zatvaranje prethodni dan, na 113.67 jena. Dolarov indeks je pao 0.1 posto, na 93.612 bodova i drži se ispod najviših razina u dva tjedna. Cijene nafte stabilizirale su se u četvrtak na međunarodnim tržištima iznad razine od 58 dolara, balansirajući između neočekivanog rasta američkih zaliha i smanjene opskrbe globalnih tržišta. Na londonskom tržištu cijena barela je ostala nepromijenjena i iznosila je 58.44 dolara, a na američkom tržištu se barelom trgovalo po 52.28 dolara.



Recepti: Štrudla od kestena - Peći i skuhati kesten, isjeći ga na manje komade, u tavi ga posuti šećerom, kratko karamelizirati, dok se šećer ne otopi. Dvije jabuke izgratati, dinstati na drugoj tavi dok ne ispari voda. Povezati jabuku i kesten, dodati korice limuna, vanilin šećer, promiješati, paziti da smjesa ima pomalo grubu teksturu. Ohladiti je. Razvaljati lisnato tijesto na pola centimetra debljine, premazati rubove žumanjkom, u sredinu staviti nadjev, zarolati. Namazati pleh, staviti štrudlu, probockati vilicom, premazati žumanjcem. Peći na 175 stupnjeva deset do 15 minuta. Prije posluživanja posuti smeđim šećerom.

Pregled novčanog tržišta

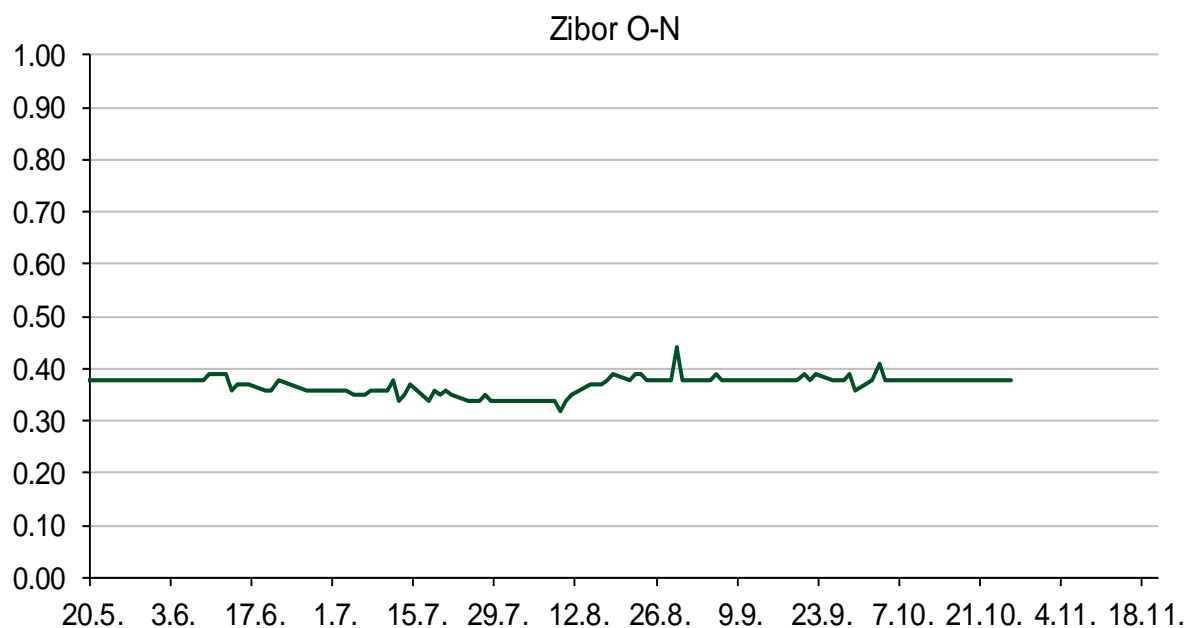
Referentne kamatne stope na dan				26.10.2017	
Opis	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	1.18444	-0.780	-	0.38	
1W	1.20247	-0.794	-0.379	0.41	
2W			-0.376	0.48	
1M	1.23999	-0.783	-0.371	0.52	
3M	1.37446	-0.726	-0.331	0.59	
6M	1.56219	-0.649	-0.274	0.67	
1Y	1.84456	-0.520	-0.183	0.78	

Vrijednost udjela fondova		25.10.2017
Fond		
PBZ Novčani fond		143,5071 HRK
PBZ Euro novčani		128,7490 EUR
PBZ Dollar		133,5631 USD
PBZ Short term bond		104,1743 HRK
PBZ Bond		135,8805 EUR
PBZ Conservative 10		116,3940 EUR
PBZ Flexible 30		104,1966 EUR
PBZ Global		15,5366 EUR
PBZ Equity		11,8522 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	-0.2857	1.6480	-0.6600
2 Y	-0.1970	1.8470	-0.5460
3 Y	-0.0885	1.9790	-0.4492
4 Y	0.0697	2.0740	-0.3292
5 Y	0.2156	2.1550	-0.1930
6 Y	0.3620	2.2270	-0.0820
7 Y	0.5044	2.2910	0.0200
8 Y	0.6390	2.3450	0.1210
9 Y	0.7660	2.3940	0.2100
10 Y	0.8670	2.4390	0.2910

PBZ Referente kamate						
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M	
Bid	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00	
Ask	1.40	1.40	1.50	1.50	1.50	
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	110.90	111.60	0.12	-0.19
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	114.20	114.90	0.41	0.13
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	122.80	123.50	1.49	1.35
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	122.80	123.50	2.08	1.98
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	100.55	100.75	-1.79	-4.63
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	103.35	103.85	0.40	-0.30
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	113.90	114.90	0.76	0.36
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	105.25	106.25	1.29	1.02
RHMF-O-227A	2.250%	07.02.2022	103.20	103.70	1.47	1.35
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	115.05	116.05	2.35	2.21
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	113.75	114.75	2.55	2.43
RHMF-O-28CA	2.875%	07.02.2028	101.15	101.65	2.75	2.69
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	100.60	0.44
Francuska	99.04	0.85
Austrija	99.05	0.60
Italija	100.88	1.96
Španjolska	99.07	1.55
Portugal	115.79	2.25
Češka	88.17	1.63
Grčka	87.67	5.57
Slovenija	102.53	0.97

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	103.85	104.05	0.26	-0.01
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.00	108.50	2.64	2.40
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	109.50	110.00	2.94	2.76
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	110.40	110.90	3.12	2.98
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	112.20	112.70	1.12	1.02
CROATIA USD 2023	5.500%	04.04.2023	110.40	110.90	3.39	3.29
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	113.75	114.25	3.52	3.44
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	106.60	107.10	2.02	1.95
CROATIA EUR 2027	3.000%	20.03.2027	104.40	104.90	2.47	2.41

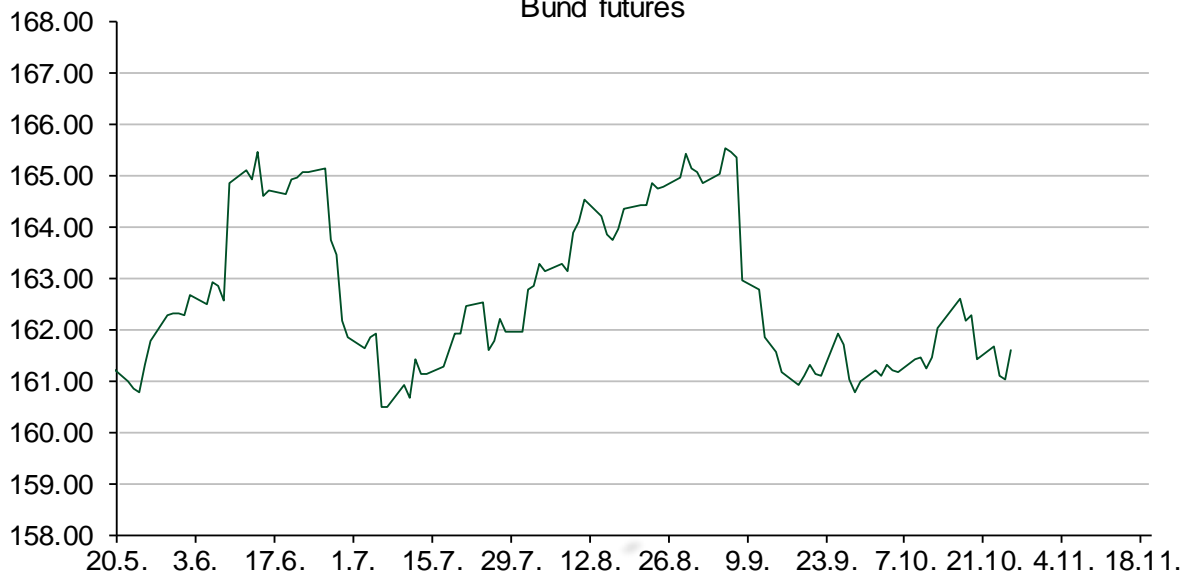
CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	19	55	101
Italija	34	93	128
Spain	24	46	67

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	27.00	28.00	89.37	86.66
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	27.00	28.00	134.89	130.45
ZG. HOLDING 2023 HRK	3.875%	15.07.2023	103.00	105.00	3.29	2.91
HEP USD	5.875%	23.10.2022	111.25	112.25	3.40	3.19

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

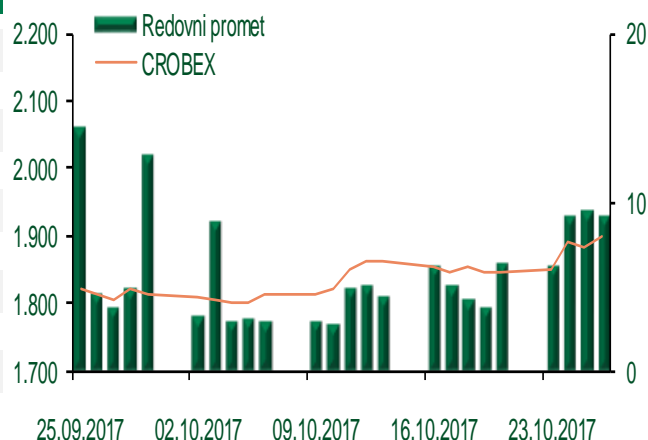
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 26.10.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	14.614,37
Redovni promet ('000 HRK)	9.114,37
Prijavljeni promet ('000 HRK)	5.500,00
OTC promet ('000 HRK)	57.952,90
Vrijednost CROBEX indeksa	1.899,11
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,83%
Promjena CROBEX indeksa u 2017.	-4,80%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.115,07
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,61%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2017.	-3,72%

Izvor: Zagrebačka burza

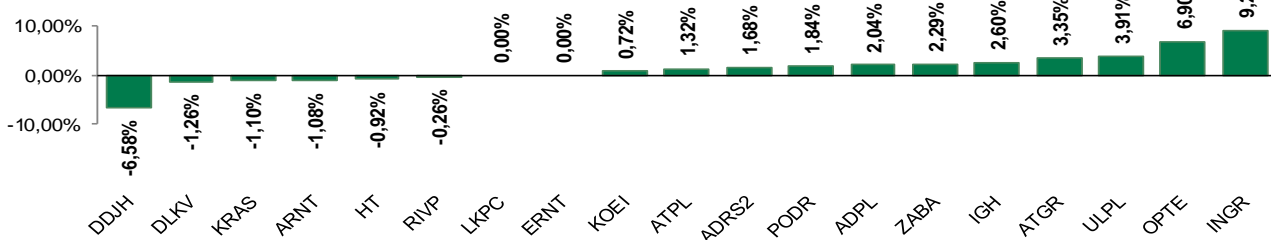
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 26.10.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
ATPL	Atlantska plovidba d.d.	537,00	1,32%	90,05%	1.349,44	749,39
PODR	Podravka prehrambena industrija d.d.	315,70	1,84%	-16,37%	920,20	2.247,78
DDJH	Đuro Đaković Grupa d.d.	35,49	-6,58%	-22,85%	642,38	269,61
ARNT	Arena Hospitality Group d.d.	460,00	-1,08%	-1,81%	559,56	2.359,21
HT	Hrvatski Telekom d.d.	172,70	-0,92%	2,19%	531,00	14.142,15

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 26.10.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	728,50	0,13%	1,55%
BELEXline	1.597,80	-0,50%	1,81%
SBI TOP	798,91	-0,73%	11,33%
SASX-10	619,30	-0,08%	-10,31%
BIRS	558,27	-0,10%	2,12%
MONEX 20	10.707,49	0,15%	-6,98%
MBI-10	2.614,63	0,00%	22,47%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 26.10.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7486,5	+0,53%	4,81%
DAX 30	13133,28	+1,39%	14,39%
CAC 40	5455,4	+1,50%	12,20%
DJIA	23400,86	+0,31%	18,41%
NASDAQ	6556,77	-0,11%	21,80%
S&P 500	2560,4	+0,13%	14,36%
NIKKEI 225	22008,45	+1,24%	15,14%

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.