

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

7. kolovoz 2018.

- EURHRK trenutno na razini 7,415
- današnji okvir trgovanja 7,38 – 7,43
- EURUSD oko 1,1574
- USDJPY oko 111,32
- Crobex u porastu
- cijena barela nafte oko 74 dolara

Pregled deviznog tržišta

Spot rates		
	BID	ASK
EURUSD	1,1576	1,1577
EURCHF	1,1525	1,1528
EURGBP	0,8930	0,8931
EURJPY	128,88	128,91
GBPUSD	1,2961	1,2965
USDJPY	111,34	111,35
GOLD	1212,41	1213,18
BRENT	72,15	72,17

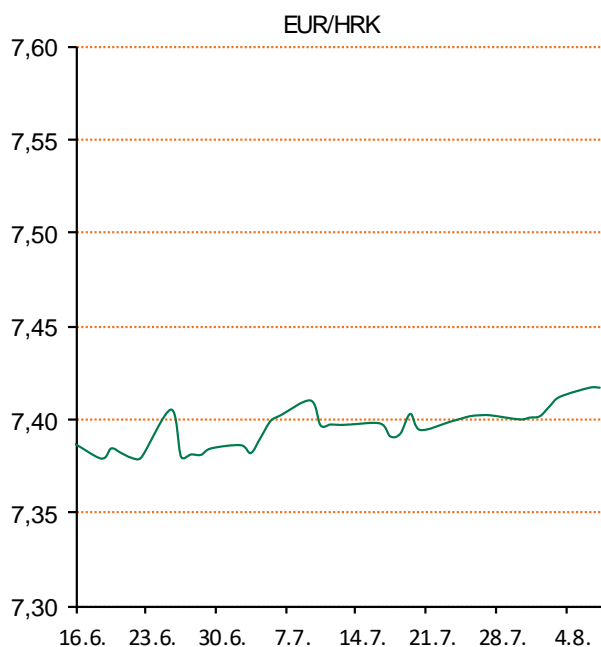
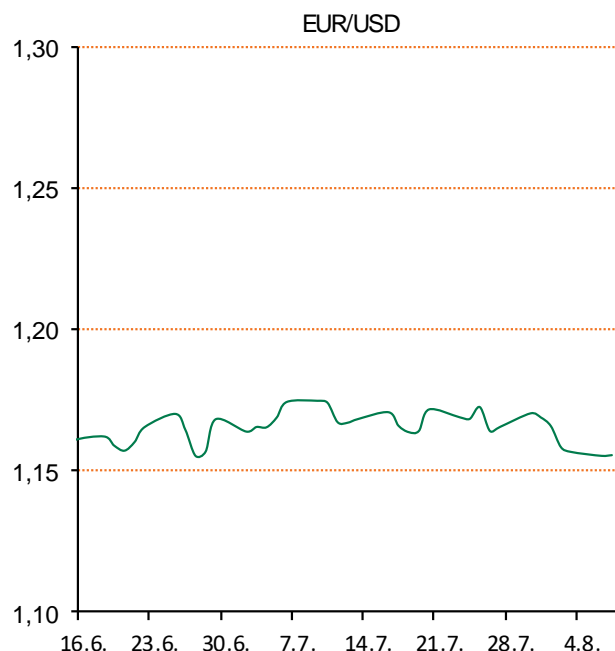
Forward points EUR/HRK		
	BID	ASK
O/N	0,2	1,4
T/N	0,2	1,5
1W	1	11
2W	1	23
1M	3	56
3M	9	160
6M	0	336
12M	15	676

Interest rate swap EUR		
	BID	ASK
1Y	-0,2613	-0,2313
2Y	-0,146	-0,141
3Y	0,0016	0,0066
4Y	0,1551	0,1651
5Y	0,3049	0,3149
7Y	0,5763	0,5863
9Y	0,81	0,82
10Y	0,8891	0,9391

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,3800	7,4300
USDHRK	6,3747	6,4185
CHFHRK	6,4018	6,4469
GBPHRK	8,2634	8,3203
JPYHRK	5,7249	5,7651
AUDHRK	4,7323	4,7650
CADHRK	4,9105	4,9444
NOKHRK	0,7748	0,7805
DKKHRK	0,9902	0,9970
SEKHRK	0,7142	0,7193
HUFHRK	2,3111	2,3275
PLNHRK	1,7361	1,7492
CZKHRK	0,2879	0,2900

Dobro jutro. U ponedjeljak rast tečaja EURHRK. Dan smo započeli na razini 7,410, a završili, 50 pipsa više, na razini 7,415. Povećana potražnja za devizama sa strane bankarskog sektora. Ključni dionički indeksi Zagrebačke burze su zabilježili rast treći dan zaredom. CROBEX je uvećan za 0,28% na 1.827,88 bodova. CROBEX10 je porastao za 0,16% na 1.062,97 bodova.

Dolar se u ponedjeljak približio najvišoj razini prema košarici ostalih ključnih valuta u nešto više od godinu dana, poduprt trgovinskim napetostima između Sjedinjenih Država i njihovih trgovinskih partnera koje prigušuju sklonost trgovaca riziku. Dolarov indeks prema košarici šest ostalih ključnih svjetskih valuta ojačao je oko 0,3% na 95,425 bodova, približivši se najvišoj razini u nešto više od godinu dana, dosegnutoj sredinom srpnja. Tečaj eura prema dolaru bio je gotovo nepromijenjen u odnosu na prethodno zatvaranje i eurom se trgovalo po 1,1543 dolara. Cijene nafte porasle su u ponedjeljak na međunarodnim tržištima prema 74 dolara slijedom neočekivanog pada proizvodnje nafte u Saudijskoj Arabiji i smanjenog broja bušotinskih postrojenja u SAD-u. Cijena barela nafte na londonskom je tržištu porasla 68 centi u odnosu na prethodno zatvaranje, na 73,89 dolara. Na američkom se tržištu barelom trgovalo po 90 centi višoj cijeni, od 69,39 dolara.



Film *The Spy Who Dumped Me* - Audrey (Mila Kunis) i Morgan (Kate McKinnon), dvije tridesetogodišnjakinje iz Los Angelesa, nađu se upletene u neočekivanu svjetsku zavjeru, kada se Audreyin bivši dečko pojavi u njihovom stanu s opasnim ubojicama za petama. Njih dvije odmah krenu u akciju, bježeći preko Europe sa šarmantnim britanskim agentom i planom za spas svijeta.

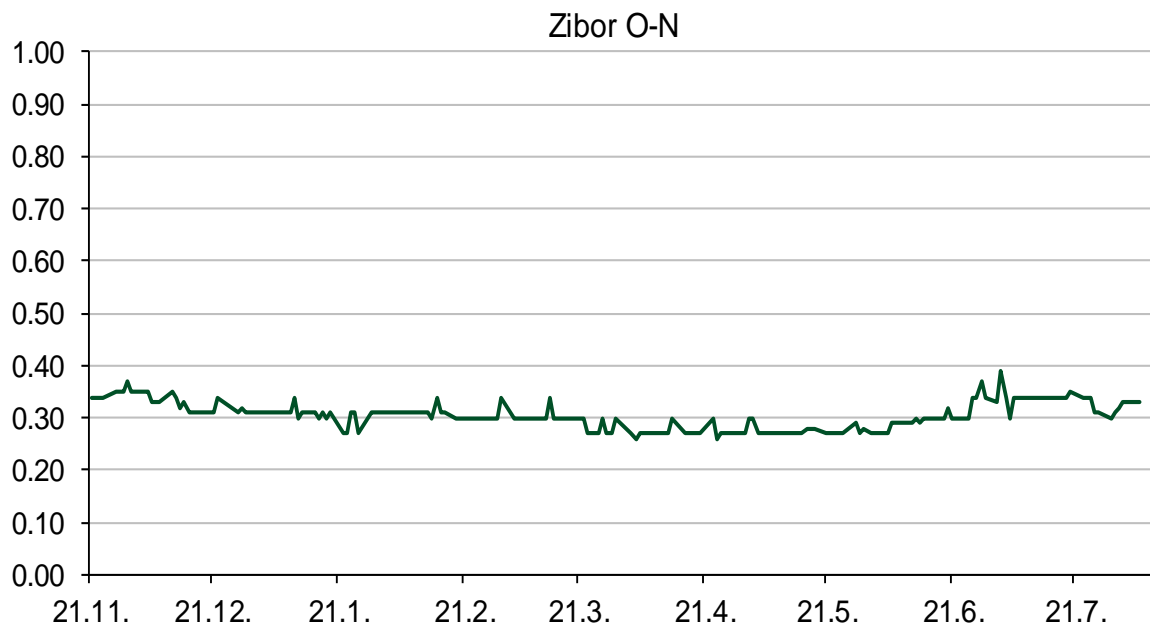
Pregled novčanog tržišta

Referentne kamatne stope na dan					Vrijednost udjela fondova	
Opis	06.08.2018			03.08.2018		
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	1.915	-0.782	-	0.33	PBZ START	143,4284 HRK
1W	1.95025	-0.790	-0.377	0.32	PBZ E START	128,7344 EUR
2W			-0.369	0.33	PBZ D START	134,9264 USD
1M	2.07931	-0.776	-0.369	0.44	PBZ Short term bond	104,6498 HRK
3M	2.343	-0.726	-0.319	0.49	PBZ Bond	138,4951 EUR
6M	2.52475	-0.648	-0.268	0.50	PBZ Conservative 10	118,6955 EUR
1Y	2.82738	-0.515	-0.176	0.53	PBZ International Multi Asset	97,5668 EUR
					PBZ Flexibile 30	104,1791 EUR
					PBZ Global	16,1984 EUR
					PBZ Equity	12,0805 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospjeća
364	HRK	0.09	335	29.05.2018	30.05.2019
364	EUR/VK	0.01	11.1	26.10.2017	25.10.2018
455	EUR	0.10	1500	09.11.2017	07.02.2019

Kamatni swapovi			
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.2700	2.6710	-0.6650
2 Y	-0.1588	2.8630	-0.5625
3 Y	-0.0100	2.9210	-0.4100
4 Y	0.1500	2.9410	-0.2625
5 Y	0.3070	2.9520	-0.1275
6 Y	0.4505	2.9600	0.0133
7 Y	0.5815	2.9700	0.1175
8 Y	0.7035	2.9810	0.2250
9 Y	0.8100	2.9930	0.3610
10 Y	0.9000	3.0060	0.4500

PBZ Referente kamate						
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M	
Bid	0.00	0.00	0.01	0.01	0.01	
Ask	0.30	0.30	0.46	0.51	0.51	
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

Euro - Val. klauzula

RHMF-O-19BA	5.375%	29.11.2019	106.90	107.60	0.08	-0.43
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	110.00	110.70	0.14	-0.28
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	122.25	122.95	0.77	0.61
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	123.50	124.20	1.58	1.47

HRK - Kunske

RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	110.30	111.10	0.19	-0.28
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	106.30	107.30	0.57	0.23
RHMF-O-222A	2.250%	07.02.2022	104.55	105.05	0.92	0.78
RHMF-O-23BA	1.750%	27.11.2023	102.95	103.45	1.17	1.08
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	117.00	118.00	1.87	1.72
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	117.00	118.00	2.03	1.90
RHMF-O-282A	2.875%	07.02.2028	105.10	105.60	2.27	2.22
RHMF-O-297A	2.375%	09.07.2029	97.80	98.30	2.61	2.55
RHMF-O-327A	3.250%	07.07.2032	103.00	104.00	2.98	2.90

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina		
Izdavatelj	Cijena	Prinos

Njemačka	98.59	0.39
Francuska	100.28	0.72
Austrija	101.42	0.60
Italija	92.58	2.92
Španjolska	99.81	1.42
Portugal	103.44	1.75
Češka	102.62	2.21
Grčka	98.12	3.99
Slovenija	100.40	0.96

Eurobonds Rep. Hrvatske						
Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask

Republika Hrvatska

CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	104.10	104.60	3.34	2.94
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	105.35	105.85	3.72	3.46
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	106.55	107.05	3.73	3.54
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	111.40	111.90	0.82	0.69
CROATIA USD 2023	5.500%	04.04.2023	106.10	106.60	4.05	3.93
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	108.50	109.00	4.24	4.14
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	108.15	108.65	1.68	1.60
CROATIA EUR 2027	3.000%	20.03.2027	105.15	105.65	2.33	2.27
CROATIA EUR 2028	2.700%	15.06.2028	100.85	101.35	2.60	2.54
CROATIA EUR 2030	2.750%	27.01.2030	99.85	100.35	2.76	2.71

CDS Pregled			
Izdavatelj	1 god	3 god	5 god

Hrvatska	16	46	90
Italija	133	200	234
Spain	30	46	67

Hrvatske korporativne obveznice						
ZG. HOLDING 2023 HRK	3.875%	15.07.2023	106.00	107.00	2.56	2.35
HEP USD	5.875%	23.10.2022	104.40	105.40	4.71	4.45

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

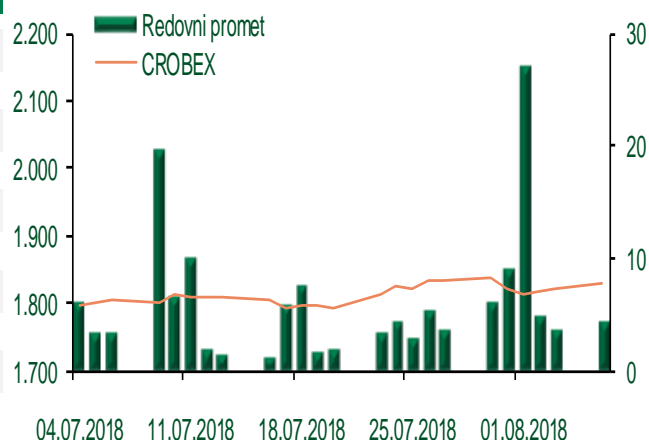
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 06.08.2018.

Ukupni promet ('000 HRK)	8.220,08
Redovni promet ('000 HRK)	4.511,09
Prijavljeni promet ('000 HRK)	3.709,00
OTC promet ('000 HRK)	5.700,61
Vrijednost CROBEX indeksa	1.827,88
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,28%
Promjena CROBEX indeksa u 2018.	-0,81%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.062,97
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,16%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2018.	-1,29%

Izvor: Zagrebačka burza

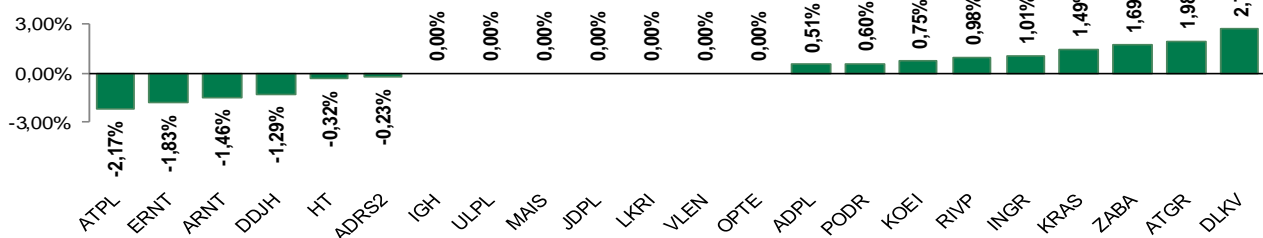
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 06.08.2018.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
RVP	Valamar Riviera d.d.	41,20	0,98%	-5,83%	3.218,21	5.192,33
HT	Hrvatski Telekom d.d.	154,50	-0,32%	-6,59%	228,73	12.618,02
ZABA	Zagrebačka banka d.d.	60,00	1,69%	13,85%	193,11	19.214,52
ADPL	AD Plastik d.d.	196,00	0,51%	15,91%	165,67	823,12
DLKV	Dalekovod d.d.	11,40	2,70%	-39,68%	135,69	281,80

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 06.08.2018.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	743,20	-0,11%	-2,18%
BELEXline	1.539,71	-0,05%	-7,39%
SBI TOP	890,73	0,36%	10,46%
SASX-10	633,67	0,00%	12,65%
BIRS	516,22	0,62%	-5,00%
MONEX 20	10.585,40	-0,18%	4,03%
MBI-10	3.354,65	0,00%	32,13%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 06.08.2018.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7663,78	+0,06%	-0,31%
DAX 30	12598,21	-0,14%	-2,47%
CAC 40	5477,18	-0,03%	3,10%
DJIA	25502,18	+0,16%	3,17%
NASDAQ	7859,68	+0,61%	13,85%
S&P 500	2850,4	+0,35%	6,61%
NIKKEI 225	22662,74	+0,69%	-0,45%

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.

Zaštita osobnih podataka:

Privredna banka Zagreb d.d., Radnička cesta 50, Zagreb, OIB 02535697732, upisana u sudski registar Trgovačkog suda u Zagrebu, pod matičnim brojem subjekta upisa (MBS) 080002817 (dalje: Banka), kao voditelj obrade osobnih podataka, posluje u skladu s načelima Uredbe (EU) 2016/679 EUROPSKOG PARLAMENTA I VIJEĆA od 27. travnja 2016. o zaštiti pojedinaca u vezi s obradom osobnih podataka i o slobodnom kretanju takvih podataka te o stavljanju izvan snage Direktive 95/46/EZ (Opća uredba o zaštiti podataka). Podaci za kontakt službenika za zaštitu podataka: sluzbenik.za.zastitu.osobnih.podataka@pbz.hr

Pri prikupljanju osobnih podataka klijenata, bilo da su prikupljeni od klijenta u trenutku njihovog prikupljanja bilo da su prikupljeni iz nekog drugog izvora, Banka pruža informacije u skladu s člancima 13. i 14. Opće uredbe o zaštiti podataka, kao što su primjerice informacije o Banci kao voditelju obrade, svrhama i pravnom temelju obrade osobnih podataka, kategorijama podataka koji se prikupljaju, razdoblju čuvanja podataka, primateljima podataka, izvoru podatka kao i o pravima u vezi zaštite osobnih podataka (primjerice, pravo na pristup podacima, pravo na brisanje, prigovor i dr.).

Osobne podatke klijenta kao i osobne podatke drugih fizičkih osoba (npr. zakonskih zastupnika, ovlaštenih potpisnika, kontakt osoba i sl.) danih u svrhu slanja ovog izvještaja Banka obrađuje i koristi zakonito, pošteno i transparentno, štiteći pri tome sigurnost osobnih podataka od neovlaštene ili nezakonite obrade, primjenjujući najviše tehničke, sigurnosne i organizacijske mjere zaštite. Detaljnije obavijesti o zaštiti privatnosti klijenta dostupne su u dokumentu "Informacija o obradi osobnih podataka fizičkih osoba u poslovanju s poslovnim subjektima" na www.pbz.hr te u poslovnim prostorijama Banke.