

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

31. listopada 2018.

- Volatilno na domaćem deviznom tržištu
- EUR/HRK unutar 7,40 – 7,45
- Značajniji rast američkih burzovnih indeksa, Crobex u blagom porastu

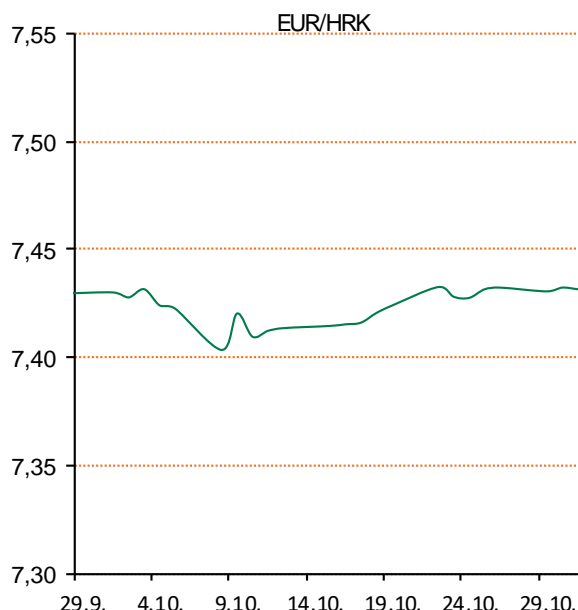
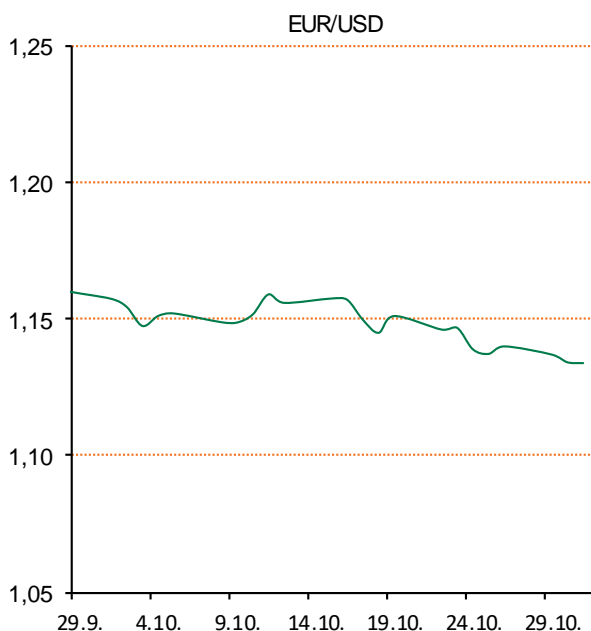
Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,1350	1,1354	O/N	0,4	1,3	1Y	-0,26	-0,21
EURCHF	1,1408	1,1413	T/N	0,8	2,6	2Y	-0,122	-0,117
EURGBP	0,8920	0,8922	1W	2	10	3Y	0,0356	0,0406
EURJPY	128,48	128,52	2W	3	21	4Y	0,2005	0,2055
GBPUSD	1,2724	1,2728	1M	6	48	5Y	0,3545	0,3595
USDJPY	113,19	113,21	3M	9	152	7Y	0,6306	0,6355
GOLD	1216,32	1216,43	6M	0	462	9Y	0,8622	0,8671
BRENT	75,82	75,84	12M	0	603	10Y	0,9455	0,9855

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4000	7,4500
USDHRK	6,5175	6,5639
CHFHRK	6,4838	6,5305
GBPHRK	8,2941	8,3520
JPYHRK	5,7579	5,7986
AUDHRK	4,6215	4,6536
CADHRK	4,9678	5,0030
NOKHRK	0,7755	0,7810
DKKHRK	0,9917	0,9985
SEKHRK	0,7113	0,7164
HUFHRK	2,2761	2,2939
PLNHRK	1,7079	1,7198
CZKHRK	0,2855	0,2875

Nakon višednevnog letargičnog trgovanja na domaćem deviznom, jučer smo za bilježili promjene. Odmah na početku trgovanja tečaj EURHRK pao je s razine 7,428 na 7,420 potaknuta većom ponudom deviza na bankarskom tržištu. Međutim tu se pojavio veliki interes za kupnjom deviza koja je tečaj podigla na razinu 7,433 kune za euro. Nakon toga bilježimo korekciju koja tečaj vraća na razinu 7,428 i na tim razinama je ostao do kraja dana. Današnje trgovanje vidimo unutar 7,40 – 7,45.

Na Wall Streetu su u utorak burzovni indeksi snažno porasli, što se zahvaljuje dobrim kvartalnim poslovnim rezultatima nekoliko kompanija i korekciji djena dionica nakon oštrog pada prethodnih tjedana. Dow Jones porastao je 431 bod ili 1,77 posto, na 24.874 boda, dok je S&P 500 skočio 1,57 posto, na 2.682 boda, a Nasdaq indeks 1,58 posto, na 7.161 bod.



Sport: Hrvatski tenisač Marin Čilić izborio je treće kolo ATP Masters 1000 turnira u Parizu nakon što je u utorak svladao Nijemca Philippa Kohlschreibera sa 6-3, 6-4 poslije sat i 12 minuta igre. U prvom setu Čilić niti jednom na svom servisu nije bio u nevolji i jedan break kod vodstva 3-2 bio mu je dovoljan da zaključi set u svoju korist. Hrvatski tenisač još je bolje krenuo u drugi set, ostvario je dva breaka i poveo 4-0, ali onda je malo posustao. Kohlschreiber je vratio jedan izgubljeni servis, no više od toga nije mogao i Čilić je zaslužen prošao u treće kolo. Bio je to njihov 12. međusobni susret, a Kohlschreiber vodi sa 7-5 u pobjedama.

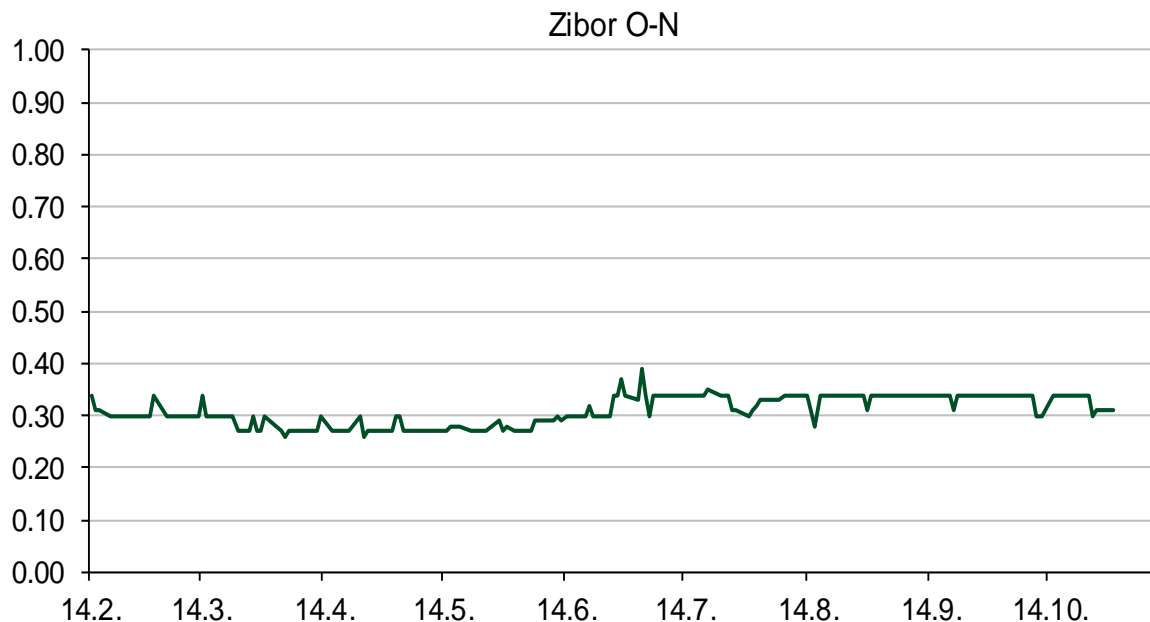
Pregled novčanog tržišta

Referentne kamatne stope na dan					Vrijednost udjela fondova	
Opis	30.10.2018			29.10.2018		
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	2.17888	-0.789	-	0.31	PBZ START	143,4187 HRK
1W	2.22625	-0.799	-0.378	0.32	PBZ E START	128,7089 EUR
2W			-0.370	0.34	PBZ D START	135,4706 USD
1M	2.302	-0.784	-0.369	0.43	PBZ Short term bond	104,6652 HRK
3M	2.52663	-0.741	-0.318	0.50	PBZ Bond	137,9876 EUR
6M	2.78175	-0.667	-0.259	0.50	PBZ Conservative 10	117,8425 EUR
1Y	3.06375	-0.532	-0.149	0.53	PBZ International Multi Asset	94,9338 EUR
					PBZ Flexibile 30	101,7656 EUR
					PBZ Global	15,6213 EUR
					PBZ Equity	11,6510 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospjeća
364	HRK	0.09	199	28.08.2018	29.08.2019
364	EUR/VK	0.00	50.0	28.08.2018	29.08.2019
182	HRK	0.06	200	07.06.2018	06.12.2018
455	EUR	0.10	1500	09.11.2017	07.02.2019

Kamatni swapovi			
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.2538	2.8950	-0.6775
2 Y	-0.1350	3.0620	-0.5525
3 Y	0.0238	3.1030	-0.3700
4 Y	0.1985	3.1150	-0.2230
5 Y	0.3506	3.1230	-0.1100
6 Y	0.4910	3.1360	0.0620
7 Y	0.6228	3.1520	0.1525
8 Y	0.7443	3.1690	0.2650
9 Y	0.8541	3.1890	0.4060
10 Y	0.9556	3.2080	0.4575

PBZ Referentne kamate						
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M	
Bid	0.00	0.01	0.01	0.01	0.01	
Ask	0.30	0.31	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	106.00	106.30	-0.21	-0.47
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	109.00	109.70	-0.20	-0.69
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	122.00	122.70	0.52	0.35
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	123.20	123.90	1.48	1.37

HRK - Kunske

RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	108.75	109.55	0.21	-0.35
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	105.60	106.60	0.64	0.28
RHMF-O-222A	2.250%	07.02.2022	104.55	105.05	0.83	0.68
RHMF-O-23BA	1.750%	27.11.2023	102.75	103.25	1.19	1.09
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	117.30	118.30	1.75	1.59
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	117.25	118.25	1.94	1.81
RHMF-O-282A	2.875%	07.02.2028	106.15	106.65	2.14	2.08
RHMF-O-297A	2.375%	09.07.2029	98.75	99.25	2.51	2.46
RHMF-O-327A	3.250%	07.07.2032	102.55	103.55	3.02	2.93

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	98.64	0.39
Francuska	99.86	0.76
Austrija	101.21	0.62
Italija	94.72	3.45
Španjolska	98.25	1.60
Portugal	102.05	1.90
Češka	103.16	2.14
Grčka	96.21	4.25
Slovenija	98.78	1.14

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

Republika Hrvatska

CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	103.00	103.50	3.69	3.19
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	104.35	104.85	3.95	3.65
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	104.90	105.40	4.20	3.98
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	110.35	110.85	0.92	0.78
CROATIA USD 2023	5.500%	04.04.2023	104.95	105.45	4.26	4.14
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	107.60	108.10	4.36	4.25
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	107.00	107.50	1.82	1.74
CROATIA EUR 2027	3.000%	20.03.2027	104.55	105.05	2.39	2.33
CROATI EUR 2028	2.700%	15.06.2028	100.50	101.00	2.64	2.58
CROATIA EUR 2030	2.750%	27.01.2030	99.50	100.00	2.80	2.75

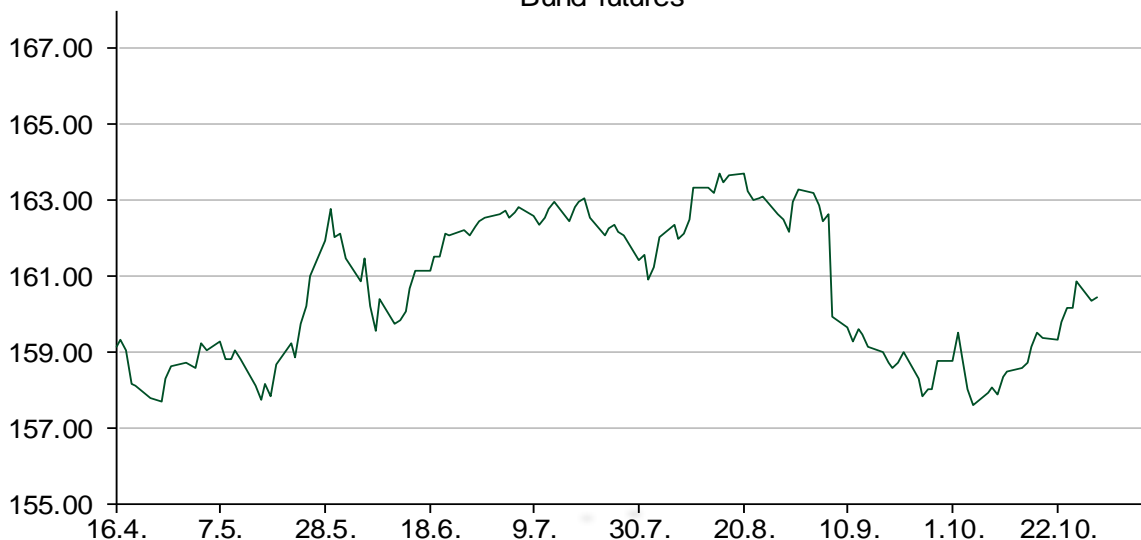
CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	22	47	92
Italija	161	234	274
Spain	34	58	84

Hrvatske korporativne obveznice

ZG. HOLDING 2023 HRK	3.875%	15.07.2023	105.50	106.50	2.61	2.39
HEP USD	5.875%	23.10.2022	104.50	105.50	4.62	4.35

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

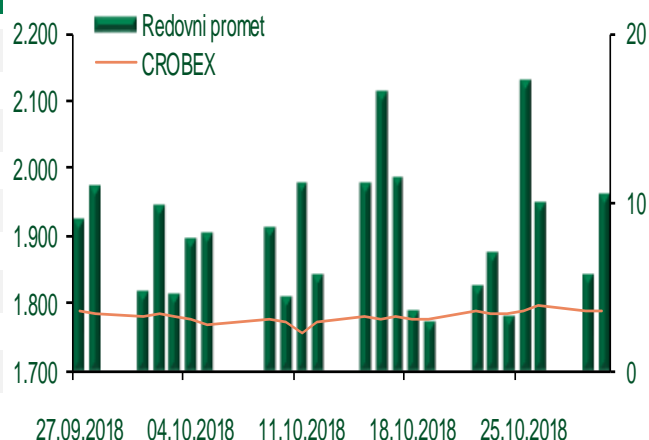
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 30.10.2018.

Ukupni promet ('000 HRK)	10.453,22
Redovni promet ('000 HRK)	10.453,22
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	2.821,61
Vrijednost CROBEX indeksa	1.789,68
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,01%
Promjena CROBEX indeksa u 2018.	-2,89%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.041,89
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,14%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2018.	-3,25%

Izvor: Zagrebačka burza

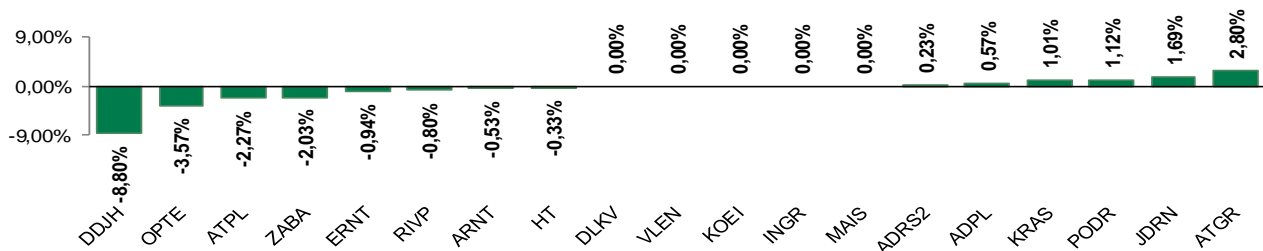
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 30.10.2018.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
MAIS	Maistra d.d.	302,00	0,00%	7,86%	2.466,67	3.305,19
PODR	Podravka prehrambena industrija d.d.	360,00	1,12%	33,33%	2.137,30	2.563,20
RVP	Valamar Riviera d.d.	37,00	-0,80%	-15,43%	1.988,68	4.663,02
HT	Hrvatski Telekom d.d.	152,50	-0,33%	-7,80%	864,61	12.454,68
ERNT	Ericsson Nikola Tesla d.d.	1.055,00	-0,94%	-12,37%	623,98	1.404,89

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 30.10.2018.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	736,13	-0,02%	-3,12%
BELEXline	1.532,38	-0,10%	-7,83%
SBI TOP	794,89	-0,86%	-1,42%
SASX-10	639,78	0,25%	13,74%
BIRS	545,01	0,14%	0,30%
MONEX 20	10.829,70	0,95%	6,43%
MBI-10	3.556,26	0,00%	40,07%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 30.10.2018.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7035,85	+0,14%	-8,48%
DAX 30	11287,39	-0,42%	-12,62%
CAC 40	4978,53	-0,22%	-6,29%
DJIA	24874,64	+1,77%	0,63%
NASDAQ	7161,65	+1,58%	3,74%
S&P 500	2682,63	+1,57%	0,34%
NIKKEI 225	21920,46	+2,16%	-3,71%

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.