

# Dnevni izvještaj financijskih tržišta

## 03. listopad 2017.

- jučerašnji dan na domaćem terenu protekao u znaku većeg akcenta na potražnju – jučerašnji "high" dana 7.497
- prema kraju dana desila se blaža korekcija na EURHRK, te se tečaj zaustavio na konačnih 7.495
- interval trgovanja u današnjem danu vidimo u okviru razina 7.47 – 7.52
- početak tjedna na inozemnim tržištima u znaku slabljenja eura naspram \$
- dolarov indeks na dobitku za 0,6%
- cijena nafte se s otvaranjem novog radnog tjedna spustila ispod \$56 po barelu
- CROBEX u minusu

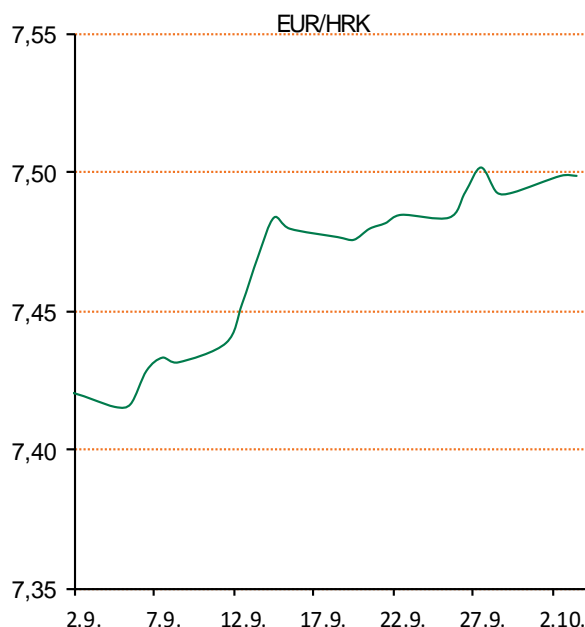
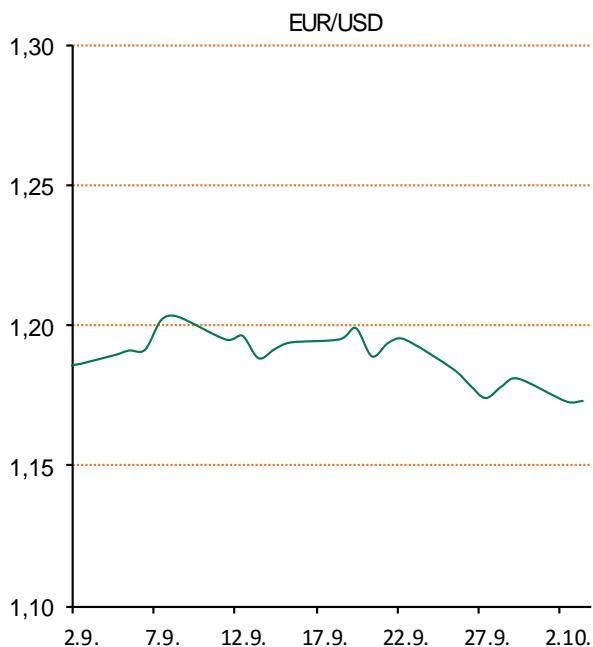
# Pregled deviznog tržišta

	Spot rates		Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,1722	1,1724	O/N	0,5	1,4	1Y	-0,2755	-0,2355
EURCHF	1,1456	1,1458	T/N	0,5	1,4	2Y	-0,171	-0,165
EURGBP	0,8826	0,8828	1W	3	10	3Y	-0,049	-0,043
EURJPY	132,55	132,58	2W	5	22	4Y	0,0924	0,1124
GBPUSD	1,3278	1,3282	1M	12	52	5Y	0,23	0,26
USDJPY	113,06	113,11	3M	9	153	7Y	0,519	0,549
GOLD	1270,18	1270,32	6M	19	341	9Y	0,782	0,812
BRENT	55,76	55,78	12M	38	760	10Y	0,893	0,933

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,4700	7,5200
USDHRK	6,3715	6,4153
CHFHRK	6,5195	6,5642
GBPHRK	8,4617	8,5203
JPYHRK	5,6343	5,6733
AUDHRK	4,9780	5,0123
CADHRK	5,0886	5,1244
NOKHRK	0,7953	0,8011
DKKHRK	1,0036	1,0104
SEKHRK	0,7796	0,7851
HUFHRK	2,3928	2,4111
PLNHRK	1,7334	1,7454
CZKHRK	0,2879	0,2899

Dobro jutro. Jučer smo dan započeli na razini 7,487 EURHRK. Tokom dana akcent je bio na potražnji i tečaj je narastao na razinu od 7,497 EURHRK. Krajem dana došlo je do blage korekcije tečaja i dan smo završili na razini 7,495. Ključni dionički indeksi Zagrebačke burze su pali drugi dan zaredom. CROBEX je umanjen za 0,20% na 1.807,53 boda. CROBEX10 je pao za 0,12% na 1.072,64 boda.

Euro je u ponedjeljak oslabio prema dolaru na međunarodnim deviznim tržištima, a trguje se oprezno ponajprije zbog napetosti u Kataloniji povezanih s referendumom o nezavisnosti. Euro je oslabio jutros prema dolaru, skliznuvši na 1,1706 dolara. Dolar je ojačao i prema jenu, za 0,3%, te se njime jutros trgovalo po 112,84 jena, u kontekstu daljnjeg jačanja prinosa na američke obveznice. Trenutna razina USDJPY je 113,12. Dolarov indeks, koji mjeri vrijednost američke prema ostalih šest najznačajnijih svjetskih valuta, jutros je u takvom ozračju bio na dobitku 0,6% na 93,588 bodova. Cijene nafte potonule su u ponedjeljak na međunarodnim tržištima ispod razine od 56 dolara, torpedirane naznakama veće proizvodnje u Sjedinjenim Državama i u Organizaciji zemalja-izvoznica nafte (OPEC). Na londonskom je tržištu cijena barela pala 1,03 dolara u odnosu na prethodno zatvaranje i iznosila je 55,76 dolara. U gotovo identičnom je iznosu barel pojeftinio i u SAD-u, gdje se njime trgovalo po cijeni od 50,60 dolara.



Film Blade Runner 2049 - Trideset godina nakon događaja iz prvog filma, novi istrebljivač, losanđeleski policajac K (Ryan Gosling) pronalazi dugo skrivenu tajnu koja ima potencijala ono malo ljudskog društva što je preostalo baciti u potpuni kaos. Njegovo otkriće odvest će ga u potragu za Rickom Deckardom (Harrison Ford), bivšim istrebljivačem koji je nestao prije trideset godina...

# Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamatne stope na dan			02.10.2017	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	1.18167	-0.789	-	0.38	
1W	1.205	-0.798	-0.380	0.41	
2W			-0.376	0.48	
1M	1.23222	-0.783	-0.373	0.52	
3M	1.33389	-0.726	-0.329	0.59	
6M	1.506	-0.649	-0.272	0.67	
1Y	1.78233	-0.511	-0.172	0.79	

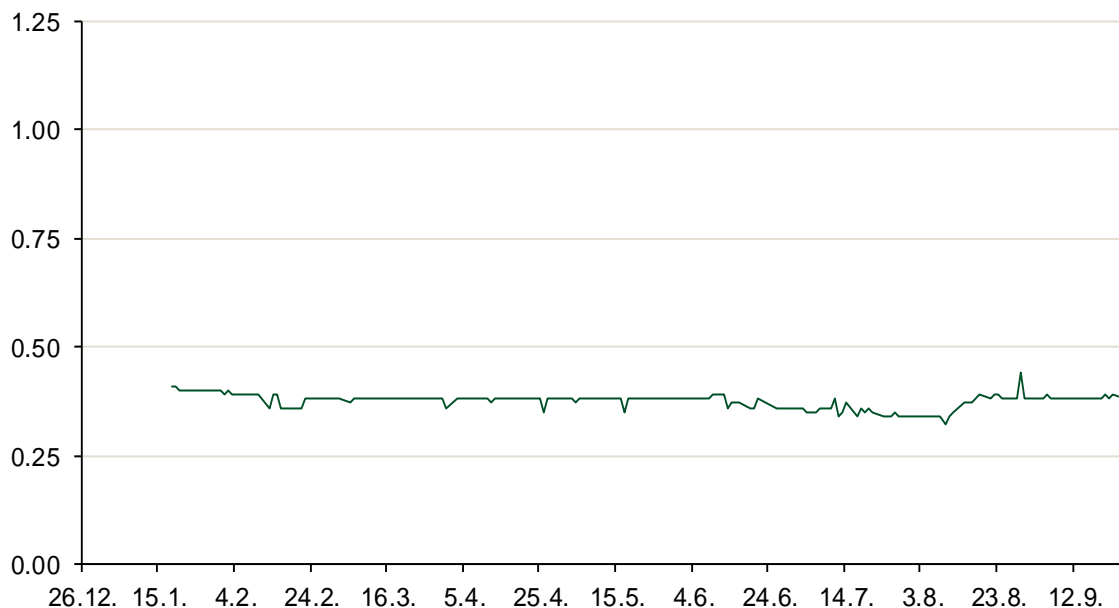
Vrijednost udjela fondova		29.09.2017
Fond		
PBZ Novčani fond		143,5025 HRK
PBZ Euro novčani		128,7555 EUR
PBZ Dollar		133,4731 USD
PBZ Short term bond		104,0792 HRK
PBZ Bond		135,8451 EUR
PBZ Conservative 10		116,2725 EUR
PBZ Flexible 30		103,9700 EUR
PBZ Global		15,4268 EUR
PBZ Equity		11,6771 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdavanja	Dat. Dospijeća
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	-0.2700	1.5690	-0.6550
2 Y	-0.1740	1.7420	-0.5330
3 Y	-0.0700	1.8540	-0.4472
4 Y	0.0896	1.9390	-0.3090
5 Y	0.2450	2.0120	-0.1960
6 Y	0.3803	2.0810	-0.0870
7 Y	0.5280	2.1450	0.0180
8 Y	0.6510	2.2020	0.1150
9 Y	0.7900	2.2530	0.2110
10 Y	0.8960	2.2980	0.2940

PBZ Referente 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
<i>Euro - Val. klauzula</i>						
RHMF-O-19BA	5.375%	29.11.2019	110.40	111.10	0.50	0.20
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	114.25	114.95	0.56	0.29
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	122.45	123.15	1.62	1.48
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	122.40	123.10	2.17	2.07
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	100.95	101.15	-0.59	-1.98
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	103.90	104.40	0.14	-0.49
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	114.00	115.00	0.88	0.50
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	104.95	105.95	1.39	1.13
RHMF-O-227A	2.250%	07.02.2022	103.00	103.50	1.53	1.42
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	114.95	115.95	2.38	2.24
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	113.70	114.70	2.57	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	100.44	0.45
Francuska	102.36	0.75
Austrija	98.83	0.63
Italija	98.62	2.22
Španjolska	97.73	1.70
Portugal	114.31	2.42
Češka	91.19	1.26
Grčka	87.48	5.58
Slovenija	102.27	1.00

## Eurobonds Rep. Hrvatske

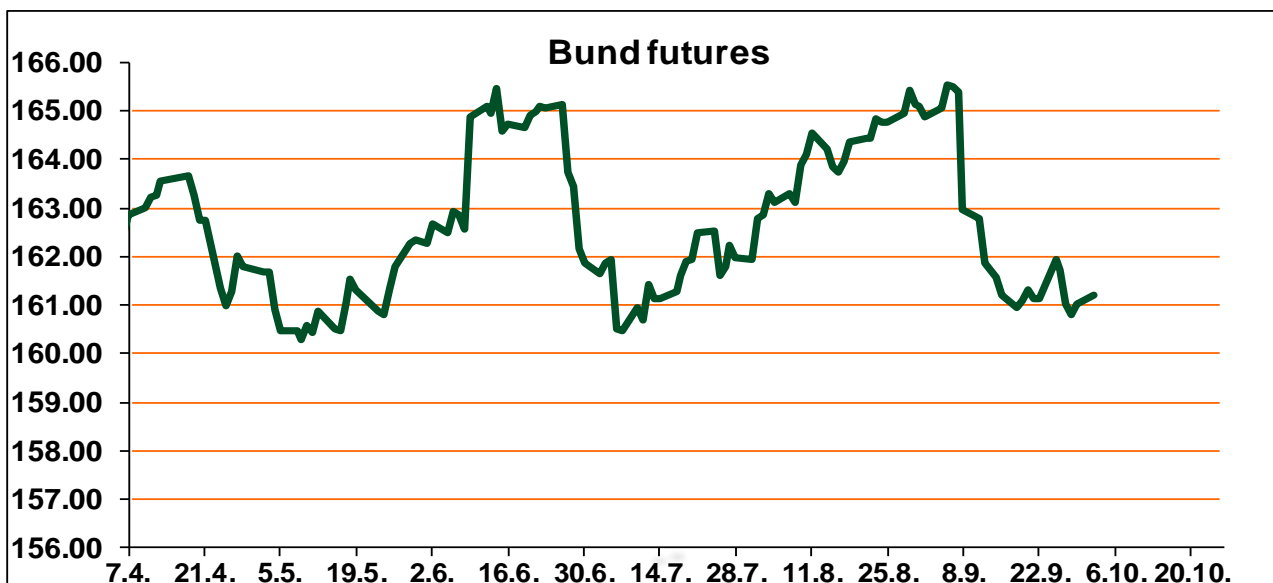
Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	104.35	104.55	0.14	-0.11
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.65	109.15	2.47	2.23
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	110.40	110.90	2.71	2.53
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	111.30	111.80	2.93	2.78
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	112.60	113.10	1.08	0.98
CROATIA USD 2023	5.500%	04.04.2023	111.50	112.00	3.20	3.11
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	114.70	115.20	3.39	3.31
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	107.45	107.95	1.91	1.84
CROATIA EUR 2027	3.000%	20.03.2027	104.95	105.45	2.41	2.35

## CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	13	48	108
Italija	46	103	141
Spain	20	46	69

## Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	28.00	29.00	84.41	81.89
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	28.00	29.00	123.90	119.95
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	1.74	-3.35
HEP USD	5.875%	23.10.2022	111.65	112.65	3.35	3.15



# Pregled dioničkog tržišta

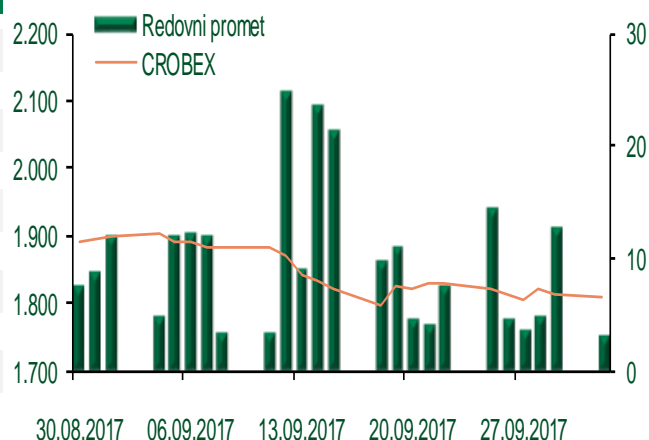
## Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 02.10.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	3.290,60
Redovni promet ('000 HRK)	3.290,60
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	130.210,48
<b>Vrijednost CROBEX indeksa</b>	<b>1.807,53</b>
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,20%
Promjena CROBEX indeksa u 2017.	-9,39%
<b>Vrijednost CROBEX10 indeksa</b>	<b>1.072,64</b>
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,12%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2017.	-7,39%

Izvor: Zagrebačka burza

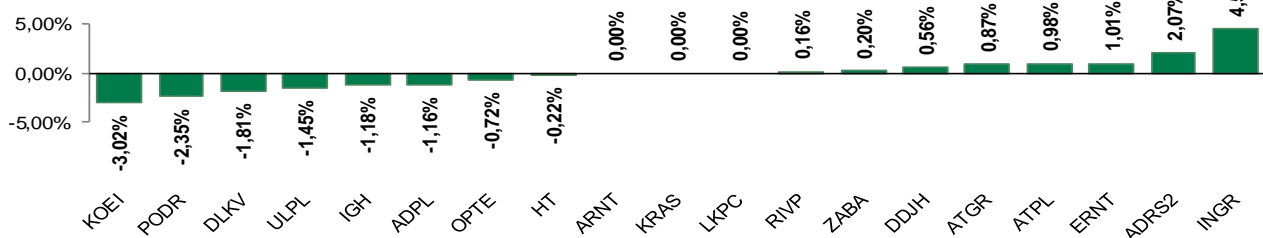
## Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



## Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 02.10.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
RVP	Valamar Riviera d.d.	43,25	0,16%	24,07%	1.369,00	5.450,69
HT	Hrvatski Telekom d.d.	175,61	-0,22%	3,91%	173,93	14.380,45
ERNT	Ericsson Nikola Tesla d.d.	1.152,50	1,01%	-0,99%	123,26	1.534,73
PLAG	Plava Laguna d.d.	6.750,00	0,00%	22,73%	121,50	3.687,65
HUPZ	HUP- Zagreb d.d.	3.141,00	0,67%	12,22%	106,76	1.356,89

## Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



## Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 02.10.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	719,50	-0,17%	0,30%
BELEXline	1.603,62	-0,04%	2,18%
SBI TOP	795,37	-0,15%	10,84%
SASX-10	633,11	0,98%	-8,31%
BIRS	559,02	0,49%	2,26%
MONEX 20	10.733,00	-0,37%	-6,76%
MBI-10	2.682,06	0,00%	25,63%

Izvor: službene stranice burzi regije

## Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 02.10.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7438,84	+0,90%	4,14%
DAX 30	12902,65	+0,58%	12,38%
CAC 40	5350,44	+0,39%	10,04%
DJIA	22557,6	+0,68%	14,14%
NASDAQ	6516,72	+0,32%	21,06%
S&P 500	2529,12	+0,39%	12,97%
NIKKEI 225	20614,07	+1,05%	7,85%

Izvor: Bloomberg

# Kontakti

## Riznica i ALM

Prodaja rizničnih proizvoda  
[treasurysales@pbz.hr](mailto:treasurysales@pbz.hr)

01 4891 301

Riznica  
[treasury@pbz.hr](mailto: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](mailto: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.