

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

07. veljače 2017.

- volatilnost kune uz naglasak na deprecijaciju kune
- CROBEX u porastu, svjetski burzovni indeksi u padu
- današnji okvir trgovanja 7,43 – 7,48
- dolar se stabilizirao naspram košarice valuta
- EURUSD oko 1,0660
- USDJPY oko 111,85
- cijene nafte nadomak 57 dolara

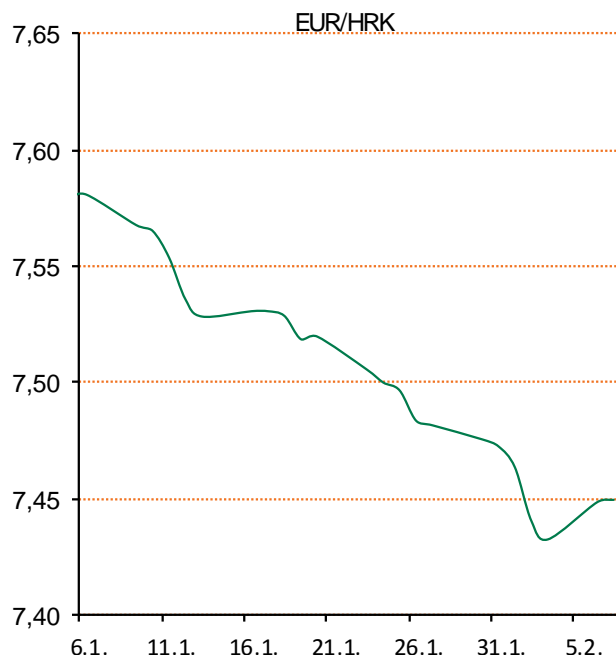
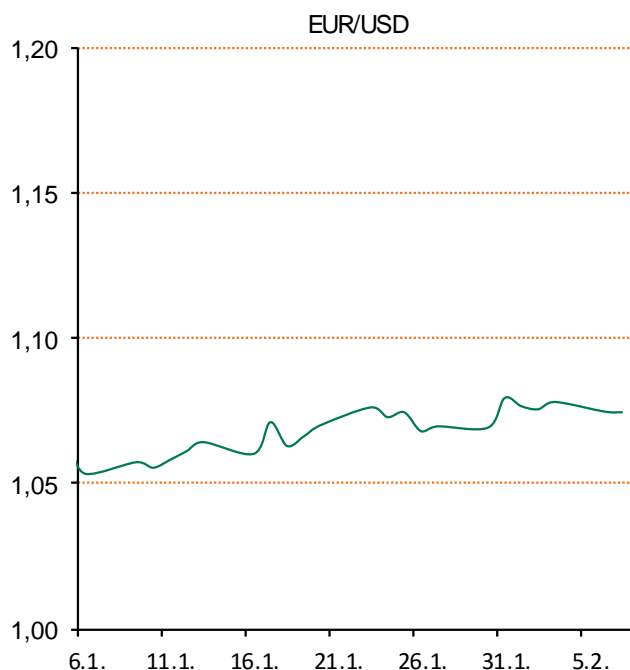
Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,0663	1,0665	O/N	-0,3	0,9	1Y	-0,215	-0,209
EURCHF	1,0662	1,0664	T/N	-0,3	0,9	2Y	-0,154	-0,148
EURGBP	0,8625	0,8630	1W	-2	7	3Y	-0,072	-0,066
EURJPY	119,64	119,65	2W	-3	15	4Y	0,025	0,032
GBPUSD	1,2359	1,2363	1M	0	35	5Y	0,13	0,16
USDJPY	112,19	112,2	3M	9	158	7Y	0,3916	0,4118
GOLD	1230,50	1230,69	6M	56	356	9Y	0,6442	0,6642
BRENT	54,71	54,73	12M	264	869	10Y	0,757	0,777

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4300	7,4800
USDHRK	6,9667	7,0149
CHFHRK	6,9674	7,0156
GBPHRK	8,6095	8,6725
JPYHRK	6,2098	6,2521
AUDHRK	5,3087	5,3451
CADHRK	5,2830	5,3204
NOKHRK	0,8364	0,8422
DKKHRK	0,9992	1,0060
SEKHRK	0,7844	0,7899
HUFHRK	2,3991	2,4180
PLNHRK	1,7376	1,7498
CZKHRK	0,2750	0,2768

Dobro jutro. U ponedjeljak volatilitet tečaja uz naglasak na deprecijaciju kune. Dan smo otvorili s kotacijom EURHRK 7,43, a zatvorili sa 7,447. Ključni dionički indeksi Zagrebačke burze su tjedan započeli rastom. CROBEX je uvećan za 0,54% na 2.182,06 bodova, na najvišu razinu od 22. srpnja 2011., kada je na zatvaranju iznosio 2.207,85 bodova. CROBEX10 je porastao za 0,38% na 1.258,83 boda.

Tečaj dolara u ponedjeljak se stabilizirao prema košarici valuta na međunarodnim tržištima, u relativno mirnom trgovanju na početku tjedna, nakon gubitka četvrti tjedan zaredom i najgoreg početka godine u zadnja tri desetljeća. U takvim je okolnostima euro oslabio prema dolaru oko 0,3% na 1,0659 dolara i drži se tako ispod najviših razina u sedam tjedana iznad 1,08 dolara, na koje se popeo prošlog tjedna. Dolar je blago oslabio naspram japanske valute, na 111,85 jena. Cijene nafte stabilizirale su se u ponedjeljak na međunarodnim tržištima nadomak razini od 57 dolara budući da su smanjena proizvodnja Organizacije zemalja izvoznica nafte (OPEC) i pojačana napetost u odnosima SAD-a i Irana nadjačali zabrinutost zbog veće američke proizvodnje. Na londonskom je tržištu cijena nafte ostala gotovo nepromijenjena u odnosu na prethodno zatvaranje i iznosila je 56,86 dolara. Značajnijih promjena u cijeni nije danas bilo ni na američkom tržištu gdje se barem trgovalo po cijeni od 53,98 dolara.



Knjiga Arhetip – od autora M.D. Waters stiže uzbuđujuć akcijski futuristički triler. Nakon proživljene nesreće glavna junakinja Emma pati od amnezije. Dok se oporavlja u bolnici predstavljaju joj šarmantnoga Declana Burkea – moćna i zavodljiva muškarca – kao muža. Njezini snovi proturječe svim njegovim pričama, a flešbekovi je podsjećaju na mjesta i događaje kojih se mutno sjeća poput strahota rata, logora za odgojžena, ljubavi prema drugom muškarcu. Nakon što se u Emminu životu pojavi Noah, njezin protivnik iz snova, zid koji je dijelio stvarnost i snove počinje se urušavati.

Pregled novčanog tržišta

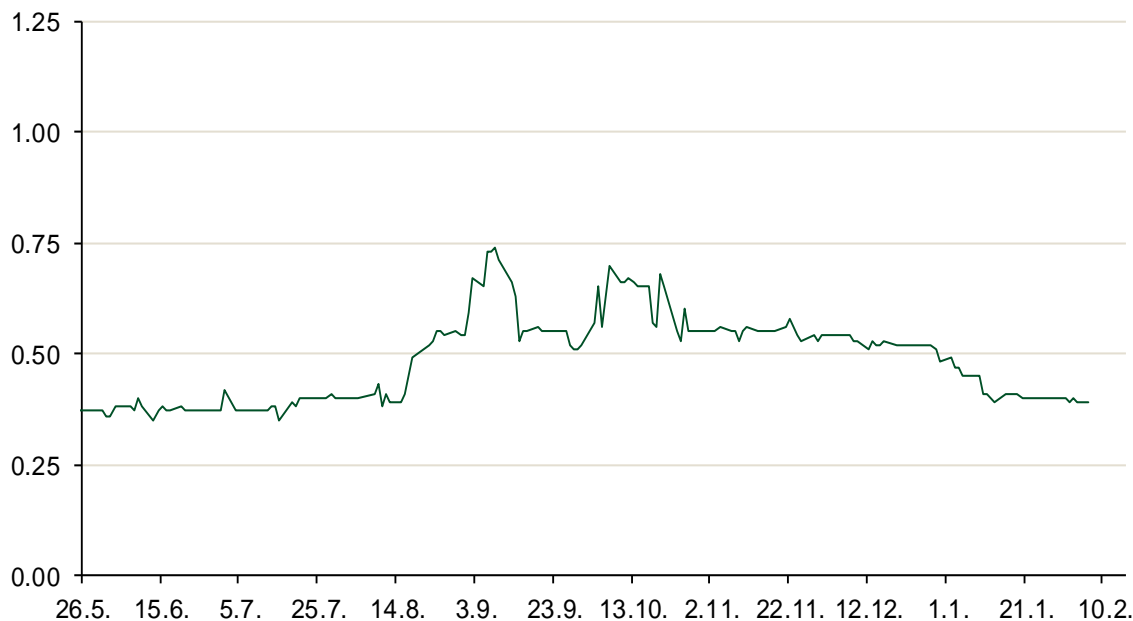
Referentne kamatne stope na dan					Vrijednost udjela fondova	
Opis	06.02.2017			03.02.2017		
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	0.69278	-0.798	-	0.39	PBZ Novčani fond	143,4656 HRK
1W	0.72167	-0.793	-0.379	0.43	PBZ Euro novčani	139,3386 EUR
2W			-0.372	0.46	PBZ Dollar	132,6653 USD
1M	0.77556	-0.788	-0.373	0.53	PBZ Short term bond	102,5560 HRK
3M	1.034	-0.726	-0.328	0.64	PBZ Bond	132,0062 EUR
6M	1.34989	-0.662	-0.244	0.76	PBZ Conservative 10	112,6092 EUR
1Y	1.71344	-0.507	-0.101	0.93	PBZ Flexibile 30	101,3594 EUR
					PBZ Global	15,4784 EUR
					PBZ Equity	12,3294 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdavanja	Dat. Dospijeaća
364	HRK	0.60	928	26.01.2017	25.01.2018
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 sw apovi			
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.2300	1.2390	-0.7250
2 Y	-0.1700	1.4790	-0.6680
3 Y	-0.0890	1.6710	-0.5830
4 Y	0.0315	1.8210	-0.4790
5 Y	0.1470	1.9410	-0.3600
6 Y	0.2711	2.0470	-0.2420
7 Y	0.3967	2.1360	-0.1330
8 Y	0.5315	2.2120	-0.0280
9 Y	0.6400	2.2770	0.0680
10 Y	0.7500	2.3340	0.1490

PBZ Referente kamate						
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M	
Bid	0.00	0.00	0.00	0.15	0.25	
Ask	0.50	0.50	0.50	0.65	0.75	
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	110.60	111.30	1.50	1.26
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	114.90	115.60	1.51	1.29
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	120.60	121.30	2.44	2.32
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	119.00	119.70	2.89	2.79
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	104.25	104.75	0.84	0.23
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	105.90	106.40	1.04	0.70
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	115.30	116.30	1.62	1.31
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	102.70	103.70	2.11	1.87
RHMF-O-227A	2.250%	07.02.2022	100.40	100.90	2.17	2.06
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	111.50	112.50	2.95	2.81
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	111.00	112.00	2.95	2.83
RHMF-O-28CA	2.875%	07.02.2028	99.35	99.85	2.94	2.89

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	98.98	0.35
Francuska	91.92	1.13
Austrija	101.09	0.63
Italija	90.52	2.35
Španjolska	95.89	1.76
Portugal	89.81	4.20
Češka	104.95	0.46
Grčka	72.66	7.75
Slovenija	135.67	1.02

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA USD 2017	6.250%	27.04.2017	100.90	101.40	1.94	-0.36
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	108.10	108.60	0.12	-0.20
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	109.00	109.50	3.28	3.10
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	109.40	109.90	3.68	3.53
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	109.50	110.00	3.86	3.73
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	108.00	108.50	2.26	2.16
CROATIA USD 2023	5.5%	04.04.2023	106.70	107.20	4.25	4.16
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	109.70	110.20	4.37	4.29
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	100.15	100.65	2.98	2.91

CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	39	115	189
Italija	88	143	184
Spain	26	55	80

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	77.00	78.00	19.69	19.15
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	77.00	78.00	23.73	23.02
ZG. HOLDING 2023 HRK	3.875%	15.07.2023	102.50	104.00	3.43	3.17
HEP USD	6.000%	09.11.2017	102.70	104.20	2.32	0.36
HEP USD	5.875%	23.10.2022	105.40	106.40	4.78	4.58

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

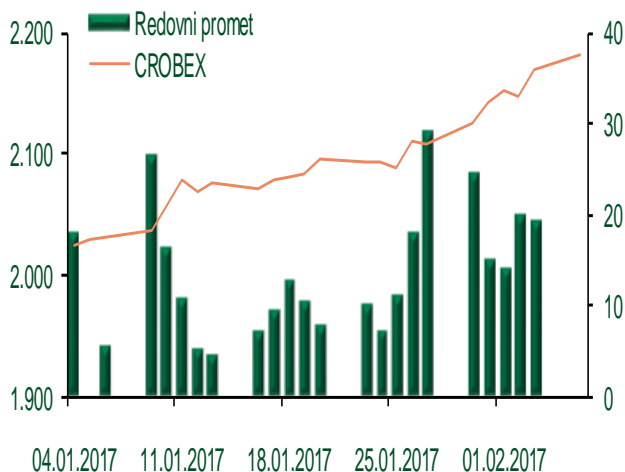
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 06.02.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	19.241,15
Redovni promet ('000 HRK)	19.241,15
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	56.755,20
Vrijednost CROBEX indeksa	2.182,06
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,54%
Promjena CROBEX indeksa u 2017.	9,39%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.258,83
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,38%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2017.	8,69%

Izvor: Zagrebačka burza

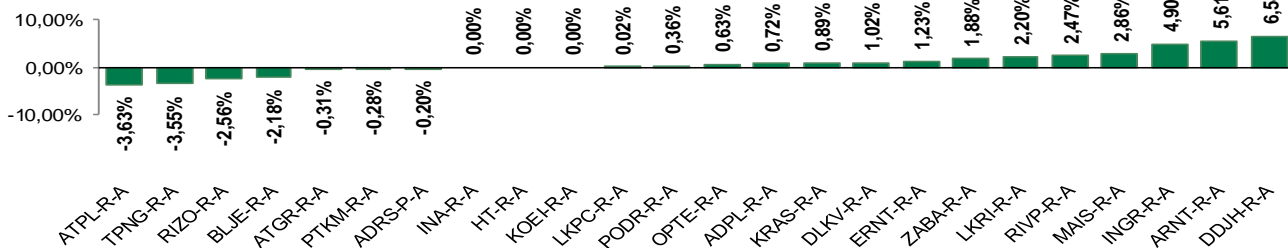
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 06.02.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	43,50	2,47%	24,78%	4.983,23	5.482,20
DDJH-R-A	Đuro Đaković Holding d.d.	49,01	6,54%	6,54%	2.223,24	158,65
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	173,50	0,00%	2,66%	2.210,05	14.207,66
JMNC-R-A	Jamnica d.d.	141.989,99	-0,01%	1,42%	1.418,94	3.141,67
LEDO-R-A	Ledo d.d.	10.050,00	-0,50%	-5,77%	1.229,18	2.212,71

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 06.02.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	700,12	0,44%	-2,40%
BELEXline	1.540,17	0,25%	-1,86%
SBI TOP	746,67	0,35%	4,05%
SASX-10	657,41	0,00%	-4,79%
BIRS	543,52	0,00%	-0,58%
MONEX 20	11.470,84	-0,14%	-0,35%
MBI-10	2.248,63	0,00%	5,33%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 06.02.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7172,15	-0,22%	0,41%
DAX 30	11509,84	-1,22%	0,25%
CAC 40	4778,08	-0,98%	-1,73%
DJIA	20052,42	-0,09%	1,47%
NASDAQ	5663,55	-0,06%	5,21%
S&P 500	2292,56	-0,21%	2,40%
NIKKEI 225	18910,78	-0,35%	-1,07%

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.