

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

08. veljače 2017.

- naizmjenično trgovanje na domaćem terenu tokom jučerašnjeg dana
- EURHRK se u prethodnom danu kretala u uskom rasponu 7.443 – 7.452
- u tekućem danu interval kretanja za domaći valutni par vidimo u okviru 7.42 – 7.47
- \$ dobio na svojoj vrijednosti kontra JPY, GBP i CHF
- podaci za američku trgovačku razmjenu lošiji od očekivanja
- Centralna banka Australije zadržala svoj kamatnjak na istoj razini
- od današnjih važnijih podataka za \$: MBA Mortgage Applications(13 h), Initial Jobless Claims i Continuing Claims (14:30 h)
- nastavak rasta CROBEX indeksa

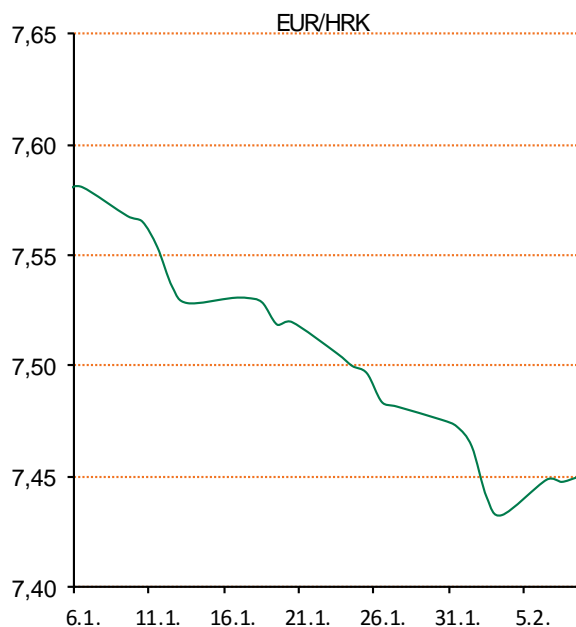
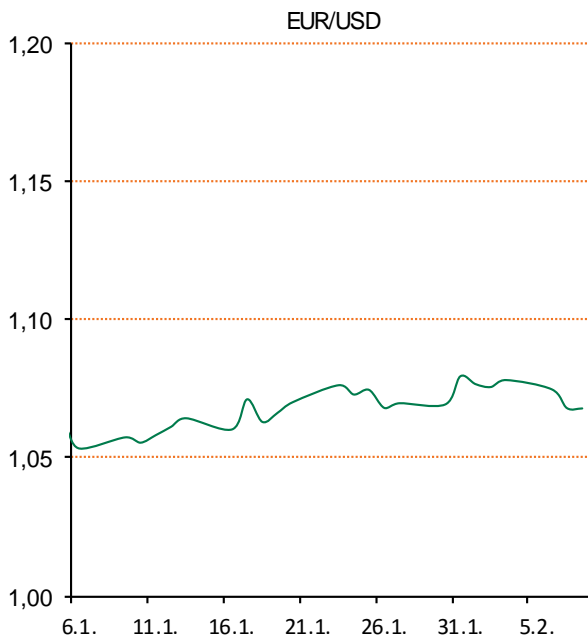
Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,0660	1,0664	O/N	-0,3	0,9	1Y	-0,2133	-0,2033
EURCHF	1,0646	1,0648	T/N	-0,3	0,9	2Y	-0,161	-0,131
EURGBP	0,8531	0,8535	1W	-2	7	3Y	-0,0889	-0,0389
EURJPY	119,77	119,81	2W	-3	15	4Y	0,03	0,04
GBPUSD	1,2492	1,2497	1M	0	35	5Y	0,138	0,168
USDJPY	112,36	112,37	3M	9	156	7Y	0,394	0,424
GOLD	1231,90	1232,65	6M	37	337	9Y	0,65	0,67
BRENT	53,48	53,50	12M	226	868	10Y	0,75	0,8

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4200	7,4700
USDHRK	6,9580	7,0075
CHFHRK	6,9684	7,0167
GBPHRK	8,6936	8,7563
JPYHRK	6,1931	6,2370
AUDHRK	5,3091	5,3456
CADHRK	5,2778	5,3190
NOKHRK	0,8343	0,8408
DKKHRK	0,9981	1,0049
SEKHRK	0,7839	0,7894
HUFHRK	2,3989	2,4178
PLNHRK	1,7246	1,7385
CZKHRK	0,2746	0,2765

Iza nas je zanimljiv dan na domaćem deviznom tržištu, odmah na početku trgovanja zbog potražnje za devizama od strane bankarskog sektora tečaj je porastao s početnih 7,447 na razinu 7,452. Na tim razinama pojavila određeni interes za prodajom deviza koja je tečaj vratila na razine 7,443 kuna za euro. Pri kraju radnog dana EUR/HRK je opet porastao na početnih 7,447 gdje smo i završili trgovanje. Današnje trgovanje vidimo unutar 7,42 - 7,47.

Američki dolar ojačao je jučer na deviznim tržištima nakon što su objavljeni podaci o američkoj trgovačkoj razmjeni koja je u siječnju pala manje nego se očekivalo, s 45,7 milijardi na 44,3 milijarde dolara. Njemačka industrijska proizvodnja pala je za 3 posto, nakon rasta od 0,50 posto u mjesecu prije. Američka valuta je ojačala u odnosu na japanski jen, funtu i švicarski franak. USD/JPY se popeo na 112,39, GBP/USD je pao na 1,2508, a USD/CHF je porastao na 0,9985. Centralna banka Australije je zadržala kamatnu stopu u veljači na rekordno niskoj razini od 1,50 posto, što je bilo u skladu sa očekivanjima.



Sport: Utakmicu punu uzbuđenja odigrali su na Camp Nou Barcelona i Atletico Madrid. Momčad Luisa Enriquea osigurala je remijem 1:1 (2:1) plasman u finale Kupa kralja. Susret su osim golova Luisa Suareza i Antoineta Griezmana obilježila tri crvena kartona, nerealizirani jedanaesterac te gruba sudačka pogreška kojom su gosti oštećeni za pogodak. Barcelona će u finalu igrati protiv boljeg iz dvoboja Alavesa i Celte Vigo. Prvi dvoboj u Vigo završio je 0-0, a uzvrat je na rasporedu u srijedu, s početkom u 21 sat.

Pregled novčanog tržišta

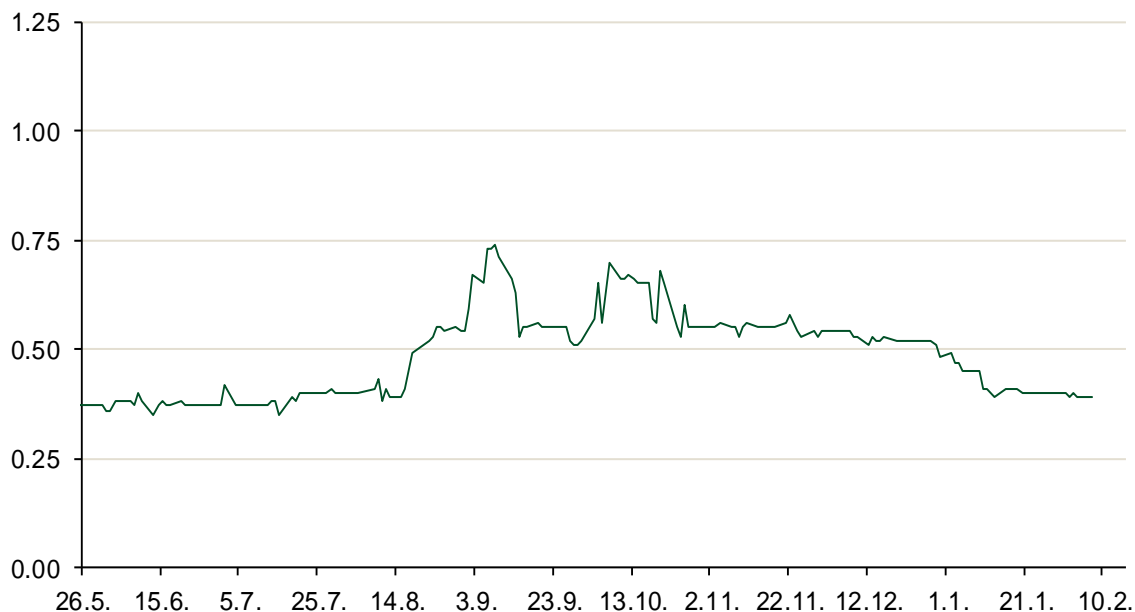
Referentne kamatne stope na dan 07.02.2017					Vrijednost udjela fondova 06.02.2017	
Opis	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	0.68833	-0.800	-	0.39	PBZ Novčani fond	143,4662 HRK
1W	0.72222	-0.795	-0.379	0.44	PBZ Euro novčani	139,3384 EUR
2W			-0.372	0.46	PBZ Dollar	132,6743 USD
1M	0.77528	-0.788	-0.373	0.53	PBZ Short term bond	102,6030 HRK
3M	1.03844	-0.726	-0.328	0.64	PBZ Bond	132,2039 EUR
6M	1.34406	-0.662	-0.244	0.76	PBZ Conservative 10	112,6850 EUR
1Y	1.70733	-0.507	-0.101	0.93	PBZ Flexible 30	101,3675 EUR
					PBZ Global	15,4995 EUR
					PBZ Equity	12,4074 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdavanja	Dat. Dospjeća
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	1.2410	-0.7250
2 Y	-0.1520	1.4840	-0.6700
3 Y	-0.0800	1.6770	-0.5830
4 Y	0.0300	1.8290	-0.4750
5 Y	0.1450	1.9500	-0.3540
6 Y	0.2770	2.0520	-0.2380
7 Y	0.4070	2.1380	-0.1240
8 Y	0.5350	2.2110	-0.0200
9 Y	0.6500	2.2720	0.0750
10 Y	0.7499	2.3260	0.1590

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
Euro - Val. klauzula						
RHMF-O-19BA	5.375%	29.11.2019	110.60	111.30	1.49	1.25
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	114.90	115.60	1.50	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	2.88	2.79
HRK - Kunske						
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	104.25	104.75	0.82	0.21
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	105.90	106.40	1.04	0.69
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	115.25	116.25	1.63	1.32
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	102.90	103.90	2.06	1.83
RHMF-O-227A	2.250%	07.02.2022	100.50	101.00	2.14	2.04
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	112.00	113.00	2.88	2.75
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	112.00	113.00	2.84	2.73
RHMF-O-28CA	2.875%	07.02.2028	99.65	100.15	2.91	2.86

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	99.03	0.35
Francuska	91.90	1.13
Austrija	101.21	0.62
Italija	90.45	2.36
Španjolska	95.79	1.77
Portugal	89.64	4.23
Češka	105.07	0.45
Grčka	72.08	7.85
Slovenija	135.47	1.03

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
Republika Hrvatska						
CROATIA USD 2017	6.250%	27.04.2017	100.90	101.40	1.89	-0.44
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	108.10	108.60	0.11	-0.22
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	109.00	109.50	3.28	3.09
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	2.25	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	30	117	189
Italija	88	144	185
Spain	26	55	81

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	78.00	79.00	19.16	18.63
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	77.00	78.00	23.75	23.04
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	2.31	0.34
HEP USD	5.875%	23.10.2022	105.40	106.40	4.78	4.58

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

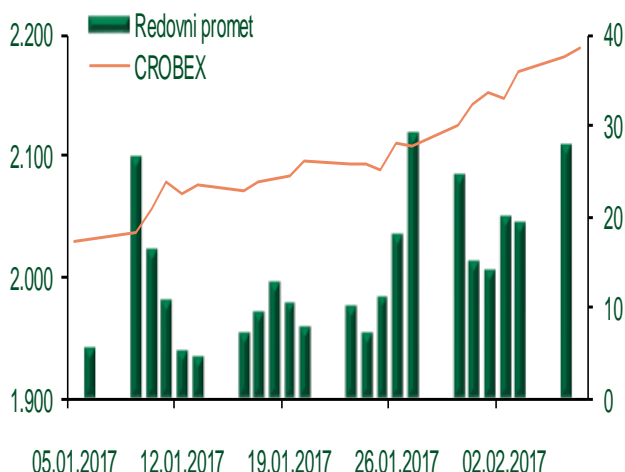
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 07.02.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	43.612,64
Redovni promet ('000 HRK)	27.764,22
Prijavljeni promet ('000 HRK)	15.848,42
OTC promet ('000 HRK)	220.750,07
Vrijednost CROBEX indeksa	2.189,82
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,36%
Promjena CROBEX indeksa u 2017.	9,77%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.263,41
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,36%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2017.	9,09%

Izvor: Zagrebačka burza

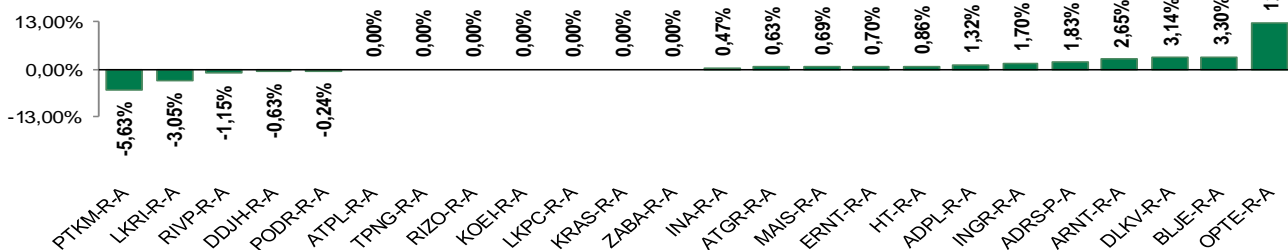
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 07.02.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
ADRS-P-A	Adris Grupa d.d.	498,98	1,83%	8,50%	10.441,83	3.385,13
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	43,00	-1,15%	23,35%	4.619,29	5.419,18
ARNT-R-A	Arenaturist d.d.	580,00	2,65%	23,80%	2.831,31	1.265,85
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	175,00	0,86%	3,55%	1.438,67	14.330,49
LEDO-R-A	Ledo d.d.	10.030,00	-0,20%	-5,95%	1.123,36	2.208,31

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 07.02.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	700,95	0,12%	-2,29%
BELEXline	1.541,38	0,08%	-1,79%
SBI TOP	754,64	1,07%	5,16%
SASX-10	659,17	0,27%	-4,53%
BIRS	544,80	0,24%	-0,34%
MONEX 20	11.539,03	0,59%	0,25%
MBI-10	2.238,16	-0,47%	4,83%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 07.02.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7186,22	+0,20%	0,61%
DAX 30	11549,44	+0,34%	0,60%
CAC 40	4754,47	-0,49%	-2,22%
DJIA	20090,29	+0,19%	1,66%
NASDAQ	5674,22	+0,19%	5,41%
S&P 500	2293,08	+0,02%	2,42%
NIKKEI 225	19007,6	+0,51%	-0,56%

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.