

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

09. veljače 2017.

- Volatilnost tečaja EURHRK
- naglasak na deprecijaciju kune naspram eura
- „range” trgovanja
- CROBEX u minusu
- euro oslabio prema dolaru
- euro oslabio i prema jenu
- jen ojačao prema dolaru

Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,0697	1,0699
EURCHF	1,0641	1,0646
EURGBP	0,8515	0,8519
EURJPY	120,08	120,18
GBPUSD	1,256	1,2565
USDJPY	112,25	112,3
GOLD	1242,14	1242,29
BRENT	54,11	54,13

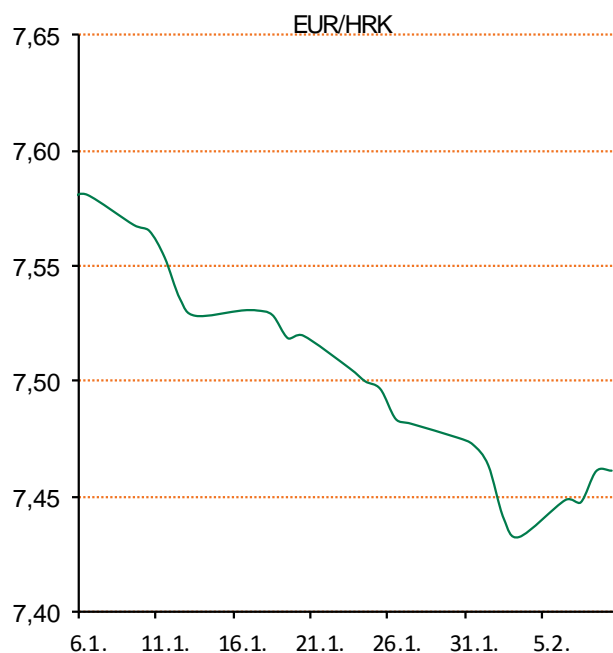
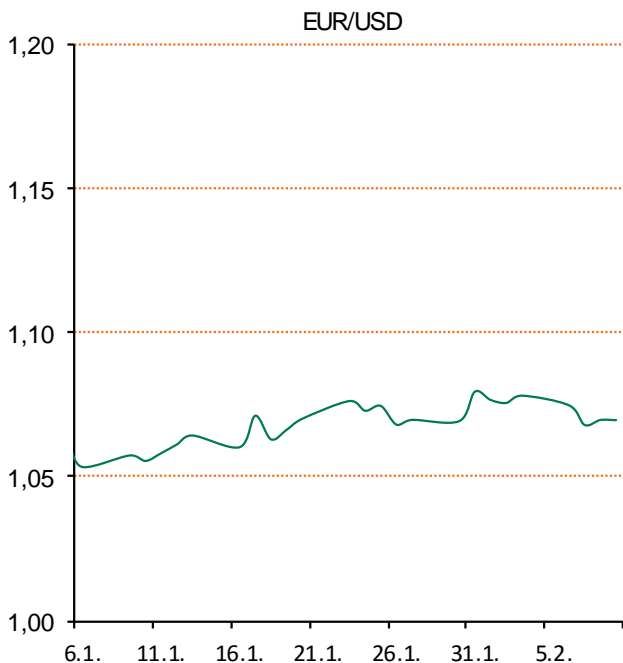
	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	-0,3	0,9
T/N	-0,9	2,8
1W	-2	7
2W	-3	15
1M	0	35
3M	9	157
6M	37	337
12M	226	870

	Interest rate swap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,23	-0,18
2Y	-0,1588	-0,1288
3Y	-0,09	-0,04
4Y	0,023	0,028
5Y	0,1338	0,1388
7Y	0,38	0,387
9Y	0,629	0,635
10Y	0,7175	0,7675

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,4400	7,4900
USDHRK	6,9539	7,0020
CHFHRK	6,9885	7,0388
GBPHRK	8,7334	8,7962
JPYHRK	6,1907	6,2375
AUDHRK	5,3041	5,3408
CADHRK	5,2916	5,3291
NOKHRK	0,8361	0,8420
DKKHRK	1,0007	1,0075
SEKHRK	0,7858	0,7914
HUFHRK	2,4061	2,4236
PLNHRK	1,7232	1,7353
CZKHRK	0,2751	0,2773

Dobro jutro. U srijedu volatilitet tečaja uz naglasak na deprecijaciju kune. Dan smo otvorili s kotacijom EURHRK 7,448, a zatvorili sa 7,456. Ključni dionički indeksi Zagrebačke burze su nakon tri dana rasta trgovanje zaključili padom. CROBEX je umanjen za 0,24% na 2.184,58 bodova. CROBEX10 je pao za 0,79% na 1.253,38 bodova.

Euro je u srijedu dodatno oslabio prema dolaru na međunarodnim tržištima jer su ulagačima ponovno u fokusu politički rizici u eurozoni, pa su utočište za kapital nastojali pronaći u valutama-utočistima poput japanske. Eurom se u takvim okolnostima trgovalo po 1,0660 dolara, što znači da je oslabio 0,2% u usporedbi sa zatvaranjem tržišta dan ranije. Euro je oslabio i 0,5% prema jenu, na 119,48 jena. Jen je ojačao i daljnjih 0,25% prema dolaru, kojim se tako trgovalo po 112,12 jena. Vjetar u leđa posljednjih dana pruža mu pojačana zabrinutost u vezi globalnih političkih rizika, a pozornost tržišta plijene i nove mjere američkog predsjednika Donalda Trumpa. Dolar su početkom tjedna pritisnuli slabiji podaci o plaćama iz najnovijeg izvješća o zaposlenosti, zbog čega su tržišta smanjila očekivanja u vezi dinamike povećanja kamatnih stopa u SAD-u u ovoj godini.



Kamo za vikend? - „Izazov moderne: Zagreb – Beč oko 1900.“ danas od 19h u galeriji Klovićevi dvori, Jezuitski trg 4, Zagreb. izložbu u kojoj ćete moći uz stručno vodstvo pogledati umjetnička djela austrijskih i hrvatskih umjetnika poput Gustava Klimta, Kolomana Mosera, Carla Molla, Vlaha Bukovca, Ivana Meštrovića i dr.

Pregled novčanog tržišta

Referentne kamatne stope na dan				08.02.2017	
Opis	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	0.68778	-0.801	-	0.39	
1W	0.72111	-0.796	-0.379	0.44	
2W			-0.372	0.46	
1M	0.77278	-0.788	-0.373	0.53	
3M	1.03817	-0.726	-0.328	0.64	
6M	1.3435	-0.662	-0.242	0.76	
1Y	1.70511	-0.508	-0.101	0.93	

Vrijednost udjela fondova		05.02.2017
Fond		
PBZ Novčani fond		143,4656 HRK
PBZ Euro novčani		139,3386 EUR
PBZ Dollar		132,6653 USD
PBZ Short term bond		102,5560 HRK
PBZ Bond		132,0062 EUR
PBZ Conservative 10		112,6092 EUR
PBZ Flexible 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. Dospijeca
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	1.2350	-0.7275
2 Y	-0.1510	1.4670	-0.6800
3 Y	-0.0780	1.6540	-0.6020
4 Y	0.0050	1.8010	-0.4910
5 Y	0.1240	1.9180	-0.3800
6 Y	0.2450	2.0180	-0.2620
7 Y	0.3750	2.1000	-0.1520
8 Y	0.4990	2.1720	-0.0490
9 Y	0.6175	2.2320	0.0450
10 Y	0.7200	2.2840	0.1170

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	1.48	1.24
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	114.90	115.60	1.49	1.28
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	120.60	121.30	2.43	2.31
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	119.00	119.70	2.88	2.79
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	104.25	104.75	0.77	0.15
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	105.90	106.40	1.01	0.67
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	115.30	116.30	1.60	1.29
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	102.70	103.70	2.10	1.87
RHMF-O-227A	2.250%	07.02.2022	100.40	100.90	2.16	2.06
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	111.50	112.50	2.94	2.81
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	112.00	113.00	2.84	2.72
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	99.39	0.31
Francuska	92.94	1.01
Austrija	101.46	0.60
Italija	91.65	2.21
Španjolska	96.61	1.68
Portugal	90.58	4.10
Češka	104.65	0.49
Grčka	72.62	7.76
Slovenija	135.58	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	1.71	-0.71
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	108.10	108.60	0.08	-0.25
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	109.00	109.50	3.27	3.08
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	109.40	109.90	3.67	3.52
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	109.50	110.00	3.85	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	39	120	194
Italija	88	144	184
Spain	26	55	80

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	77.00	78.00	19.73	19.19
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	77.00	78.00	23.80	23.08
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	2.27	0.27
HEP USD	5.875%	23.10.2022	105.40	106.40	4.78	4.58

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

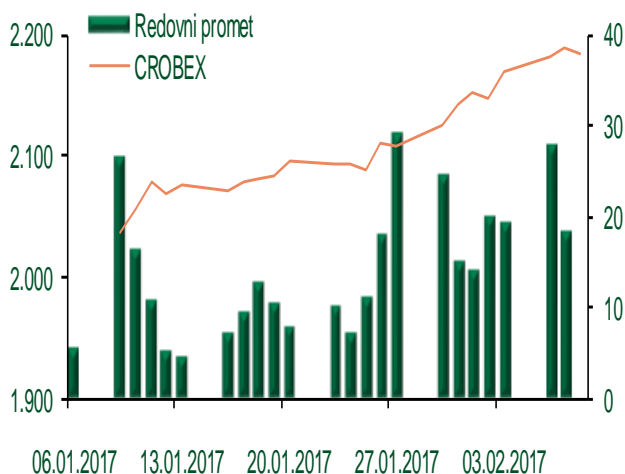
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 08.02.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	18.283,31
Redovni promet ('000 HRK)	18.283,31
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	201.116,12
Vrijednost CROBEX indeksa	2.184,58
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,24%
Promjena CROBEX indeksa u 2017.	9,51%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.253,38
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,79%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2017.	8,22%

Izvor: Zagrebačka burza

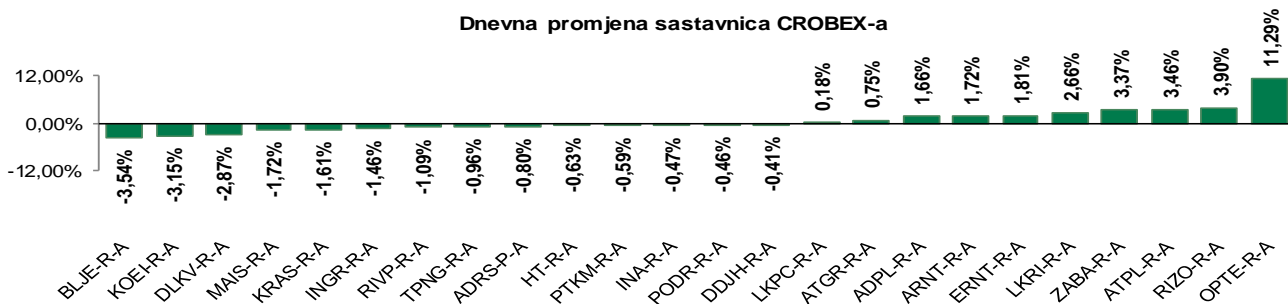
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 08.02.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	173,90	-0,63%	2,90%	5.809,48	14.240,42
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	42,53	-1,09%	22,00%	2.598,48	5.359,95
OPTE-R-A	OT-optima telekom d.d.	4,04	11,29%	50,19%	2.418,20	11,39
ADRS-P-A	Adris Grupa d.d.	495,00	-0,80%	7,63%	1.661,66	3.358,13
HUPZ-R-A	HUP Zagreb d.d.	2.800,00	0,00%	0,04%	744,77	1.387,68

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 08.02.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	699,63	-0,19%	-2,47%
BELEXline	1.531,11	-0,67%	-2,44%
SBI TOP	754,64	1,07%	5,16%
SASX-10	659,72	0,00%	-4,45%
BIRS	544,80	0,24%	-0,34%
MONEX 20	11.459,67	-0,69%	-0,44%
MBI-10	2.261,10	0,00%	5,91%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 08.02.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7188,82	+0,04%	0,64%
DAX 30	11543,38	-0,05%	0,54%
CAC 40	4766,6	+0,26%	-1,97%
DJIA	20054,34	-0,18%	1,48%
NASDAQ	5682,45	+0,15%	5,56%
S&P 500	2294,67	+0,07%	2,49%
NIKKEI 225	18907,67	-0,53%	-1,08%

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.