

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

03. siječanj 2020.

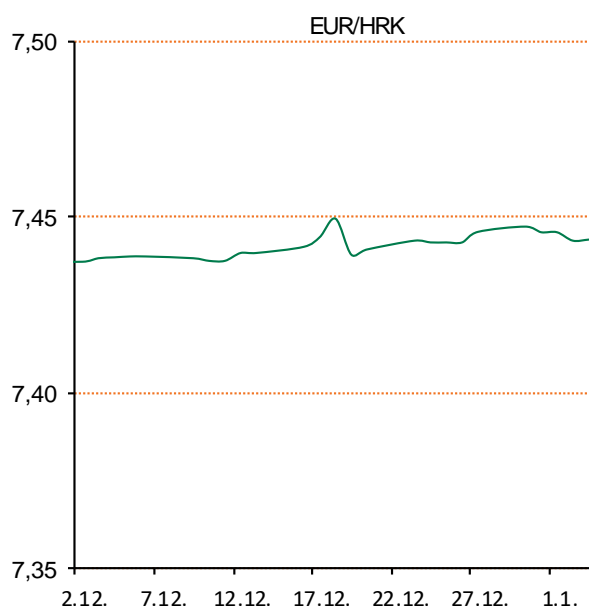
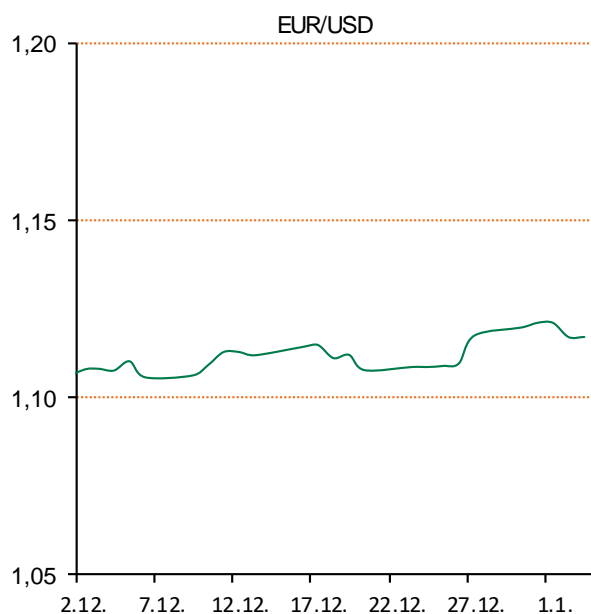
Pregled deviznog tržišta

Spot rates		
	BID	ASK
EURUSD	1,1156	1,1158
EURCHF	1,0837	1,0840
EURGBP	0,8519	0,8523
EURJPY	120,45	120,46
GBPUSD	1,3093	1,3096
USDJPY	107,94	107,98
GOLD	1543,51	1543,89
BRENT	68,24	68,26

Forward points EUR/HRK		
	BID	ASK
O/N	1,7	5,8
T/N	0,4	1,4
1W	3	10
2W	6	20
1M	13	46
3M	33	141
6M	56	301
12M	76	609

Interest rate swap EUR		
	BID	ASK
1Y	-0,3224	-0,3163
2Y	-0,3111	-0,3011
3Y	-0,2783	-0,2583
4Y	-0,222	-0,217
5Y	-0,1711	-0,1651
7Y	-0,0549	-0,0449
9Y	0,0712	0,0812
10Y	0,1339	0,1399

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,4200	7,4700
USDHRK	6,6499	6,6959
CHFHRK	6,8450	6,8931
GBPHRK	8,7059	8,7686
JPYHRK	6,1597	6,2017
AUDHRK	4,6236	4,6551
CADHRK	5,1289	5,1653
NOKHRK	0,7546	0,7601
DKKHRK	0,9929	0,9997
SEKHRK	0,7071	0,7119
HUFHRK	2,2536	2,2693
PLNHRK	1,7484	1,7603
CZKHRK	0,2926	0,2947



Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamatne stope na dan			02.01.2020
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	
O/N	1,54263	-0,792	-	
1W	1,63	-0,781	-0,491	
2W				
1M	1,7625	-0,781	-0,436	
3M	1,90838	-0,688	-0,379	
6M	1,91213	-0,622	-0,323	
1Y	1,99625	-0,481	-0,248	

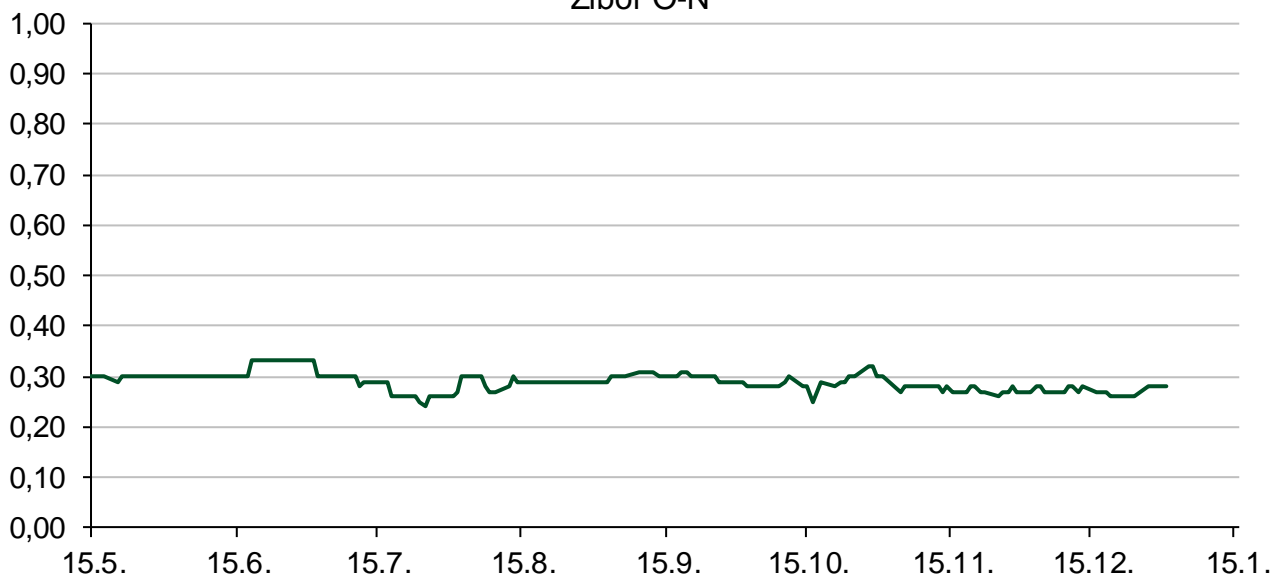
Vrijednost udjela fondova		31.12.2019
Fond		
PBZ START		143,6531 HRK
PBZ D START		138,9843 USD
PBZ Short term bond		105,5989 HRK
PBZ Euro Short Term Bond		100,4810 EUR
PBZ Bond		143,2906 EUR
PBZ Conservative 10		123,1047 EUR
PBZ International Multi Asset		99,8121 EUR
PBZ Flexible 30		108,5641 EUR
PBZ Global		17,4159 EUR
PBZ Equity		13,6741 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospijeća
364	HRK	0,06	1430	30.12.2019	31.12.2020
364	HRK	0,06	1761	03.12.2019	03.12.2020
364	EUR VK	-0,05	58	22.10.2019	22.10.2020
364	HRK	0,06	711	22.10.2019	22.10.2020

	Kamatni swapovi		
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0,3300	1,7240	-0,6750
2 Y	-0,3100	1,6180	-0,6440
3 Y	-0,2700	1,5930	-0,5950
4 Y	-0,2259	1,6000	-0,5375
5 Y	-0,1730	1,6220	-0,4750
6 Y	-0,1180	1,7160	-0,4075
7 Y	-0,0559	1,6850	-0,3490
8 Y	0,0054	1,7160	-0,2860
9 Y	0,0709	1,7480	-0,2175
10 Y	0,1308	1,7790	-0,1710

Info tržišne kamate						
	HRK	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid		0,01	0,01	0,01	0,01	0,01
Ask		0,21	0,21	0,21	0,26	0,31
	EUR	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid		-0,50	-0,50	-0,50	-0,45	-0,45
Ask		0,01	0,01	0,05	0,10	0,12
	USD	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid		1,85	1,85	1,90	2,00	2,00
Ask		2,55	2,55	2,60	2,75	3,00

Zibor O-N



Pregled tržišta obveznica

Obveznice Republike Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos		
			Bid	Ask	Bid	Ask	
<i>Euro - Val. klauzula</i>							
RHMF-O-203E	6,500%	05.03.2020	101,00	101,50	0,22	-2,81	
RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	115,95	116,65	0,20	-0,05	
RHMF-O-222E	0,500%	05.02.2022	100,50	101,00	0,26	0,02	
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	123,75	124,45	0,43	0,29	

HRK - Kunske

RHMF-O-203A	6,750%	05.03.2020	101,10	101,35	-0,15	-1,66
RHMF-O-217A	2,750%	08.07.2021	103,85	104,35	0,18	-0,14
RHMF-O-222A	2,250%	07.02.2022	104,15	104,65	0,25	0,02
RHMF-O-23BA	1,750%	27.11.2023	105,70	106,20	0,27	0,15
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	122,35	122,85	0,39	0,31
RHMF-O-26CA	4,250%	14.12.2026	125,65	126,15	0,48	0,42
RHMF-O-282A	2,875%	07.02.2028	118,00	118,50	0,59	0,53
RHMF-O-297A	2,375%	09.07.2029	115,80	116,30	0,66	0,61
RHMF-O-327A	3,250%	07.07.2032	122,45	123,45	1,30	1,22
RHMF-O-34BA	1,000%	27.11.2034	97,45	98,45	1,19	1,11

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	102,62	-0,27
Francuska	99,58	0,04
Austrija	105,08	-0,06
Italija	99,90	1,37
Španjolska	101,77	0,42
Portugal	114,46	0,39
Češka	109,43	1,67
Grčka	120,79	1,44
Slovenija	108,45	0,26

Republika Hrvatska

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
CROATIA USD 2020	6,625%	14.07.2020	102,30	102,80	2,14	1,20
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	105,25	105,75	1,97	1,56
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	109,25	109,75	0,01	-0,19
CROATIA USD 2023	5,500%	04.04.2023	110,30	110,80	2,19	2,04
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	114,55	115,05	2,22	2,10
CROATIA EUR 2025	3,000%	11.03.2025	113,20	113,70	0,42	0,33
CROATIA EUR 2027	3,000%	20.03.2027	117,00	117,50	0,58	0,52
CROATIA EUR 2028	2,700%	15.06.2028	116,90	117,40	0,64	0,58
CROATIA EUR 2029	1,125%	12.06.2029	103,45	103,95	0,75	0,69
CROATIA EUR 2030	2,750%	27.01.2030	119,25	119,75	0,75	0,71

Hrvatske korporativne obveznice

ZG. HOLDING 2023 HRK	3,875%	15.07.2023	107,80	108,80	1,58	1,30
HEP USD	5,875%	23.10.2022	109,50	110,50	2,34	1,99

CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	14	33	62
Italija	43	89	128
Spain	12	27	41

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

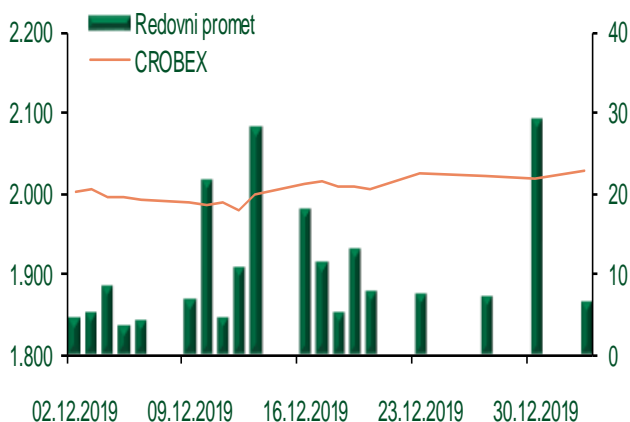
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 02.01.2020.

Ukupni promet ('000 HRK)	8.923,92
Redovni promet ('000 HRK)	6.614,97
Prijavljeni promet ('000 HRK)	2.308,95
OTC promet ('000 HRK)	154.176,43
Vrijednost CROBEX indeksa	2.029,25
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,59%
Promjena CROBEX indeksa u tekućoj godini	0,59%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.202,65
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,23%
Promjena CROBEX10 indeksa u tekućoj godini	0,23%

Izvor: Zagrebačka burza

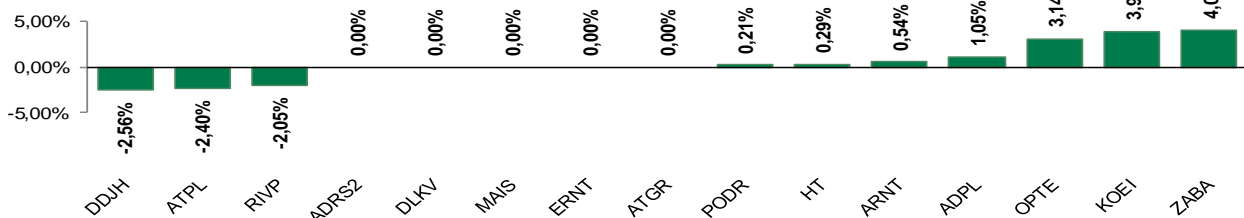
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 02.01.2020.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
HT	Hrvatski Telekom d.d.	175,50	0,29%	0,29%	2.674,53	14.254,03
OPTE	OT-optima telekom d.d.	8,20	3,14%	3,14%	740,46	569,43
ZABA	Zagrebačka banka d.d.	64,50	4,03%	4,03%	717,60	20.655,61
RVP	Valamar Riviera d.d.	38,20	-2,05%	-2,05%	379,04	4.814,25
KOEI	Končar - elektroindustrija d.d.	660,00	3,94%	3,94%	286,12	1.697,60

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 02.01.2020.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	801,69	1,44%	0,00%
BELEXline	1.726,82	0,87%	0,00%
SBI TOP	926,10	0,00%	0,00%
SASX-10	808,90	-1,99%	0,00%
BIRS	618,31	1,32%	0,00%
MONEX 20	11.403,61	-0,13%	0,00%
MBI-10	4.645,17	-0,08%	-0,08%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 02.01.2020.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7.604,30	0,82%	0,82%
DAX 30	13.385,93	1,03%	1,03%
CAC 40	6.041,50	1,06%	1,06%
DJIA	28.868,80	1,16%	1,16%
NASDAQ	9.092,19	1,33%	1,33%
S&P 500	3.257,85	0,84%	0,84%
NIKKEI 225	23.656,62	-0,76%	0,00%

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.