

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

21. listopada 2020.

- pad tečaja EUR/HRK
- domaći valutni par danas unutar 7,54 – 7,59
- održana aukcija trezorskih zapisa
- američki dolar u silaznom trendu
- nafta iznad 41 dolar
- CROBEX u minusu

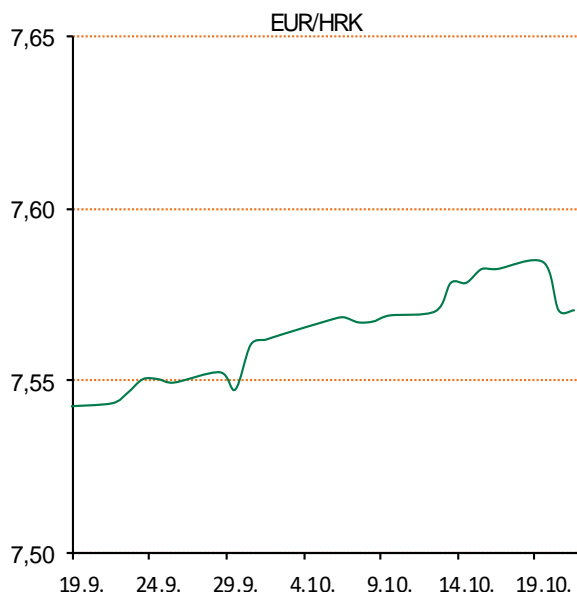
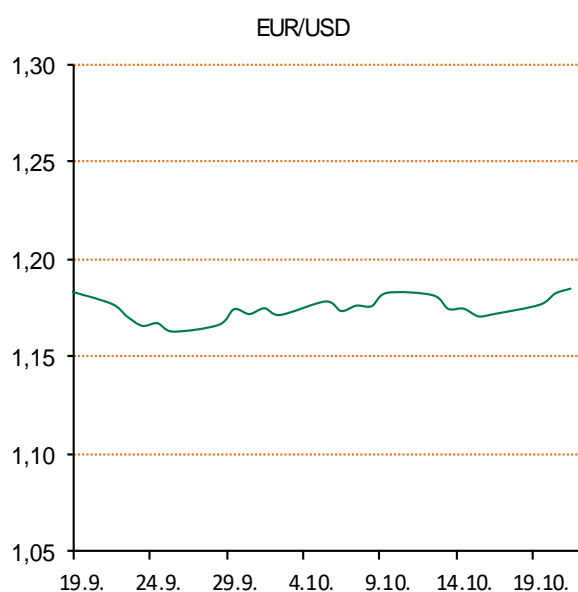
Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,1850	1,1854	O/N	0,8	1,5	1Y	-0,5225	-0,4925
EURCHF	1,0726	1,0727	T/N	0,8	1,5	2Y	-0,521	-0,517
EURGBP	0,9106	0,9107	1W	6	10	3Y	-0,515	-0,51
EURJPY	124,58	124,59	2W	10	21	4Y	-0,5	-0,48
GBPUSD	1,3014	1,3015	1M	20	46	5Y	-0,473	-0,468
USDJPY	105,11	105,13	3M	39	155	7Y	-0,3881	-0,3781
GOLD	1917,99	1918,79	6M	38	325	9Y	-0,3003	-0,2903
BRENT	40,63	40,65	12M	0	691	10Y	-0,269	-0,229

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,5400	7,5900
USDHRK	6,3607	6,4051
CHFHRK	7,0290	7,0763
GBPHRK	8,2793	8,3352
JPYHRK	6,0519	6,0925
AUDHRK	4,5023	4,5324
CADHRK	4,8548	4,8873
NOKHRK	0,6892	0,6941
DKKHRK	1,0131	1,0199
SEKHRK	0,7292	0,7342
HUFHRK	2,0782	2,0932
PLNHRK	1,6525	1,6639
CZKHRK	0,2778	0,2797

Utorak je na domaćem deviznom tržištu donio snažne aprecijacijske pritiske na kunu u odnosu na jedinstvenu europsku valutu. Tečaj EUR/HRK pao je s razine 7,580 na 7,572 kuna za euro potaknut ponudom deviza prvenstveno od strane bankarskog sektora. Međutim od strane korporativnih klijenata potražnja je bila veća od ponude, što je držalo tečaj na tim razinama do pred kraj dana, no tada je tečaj je krenuo prema još nižim razinama te smo zatvorili na 7,566 kuna za euro. Današnje trgovanje vidimo unutar intervala 7,54-7,59. Ministarstvo financija u utorak je na aukciji, prvog nakon kolovoza, prodalo 415 milijuna kuna trezorskih zapisa, uz kamatnu stopu koja se zadržala na niskih 0,06 posto.

Na stranim valutnim je tržištima vrijednost dolara prema košarici valuta pala drugi dan zaredom i zaronila na najnižu razinu u mjesec dana, što je posljedica optimizma ulagača u vezi poticajnih mjera u SAD-u. Tečaj dolara prema japanskoj valuti skliznuo je s jučerašnjih 105,45 na 105,30 jena, a američka je valuta oslabila i u odnosu na europsku, pa je cijena eura dosegla 1,1845 dolara. Cijene su nafte nakon jučerašnjeg rasta jutros pale jer daljnje širenje koronavirusa vodi do novih restriktivnih mjera, što bi moglo narušiti oporavak gospodarstva, a time i potražnje za naftom.



Sport: MANCHESTER UNITED uzeo je tri boda na gostovanju kod PSG-a u prvom kolu Lige prvaka. United je pobijedio 2:1, Fernandes je zabio za vodstvo, PSG je izjednačio autogolom Martiala, a pobjedu je donio Rashford u završnici susreta. PSG nikada u 90 minuta nije uspostavio dominaciju na terenu, Neymar i Mbappé nisu imali puno prostora dok je United prevladao u sredini i to je bio ključ pobjede.

Pregled novčanog tržišta

Opis	Libor USD	Libor CHF	Euribor	20.10.2020
O/N	0,08088	-0,799	-	
1W	0,10663	-0,821	-0,536	
2W				
1M	0,14338	-0,797	-0,543	
3M	0,20863	-0,762	-0,507	
6M	0,25425	-0,727	-0,498	
1Y	0,33975	-0,612	-0,473	

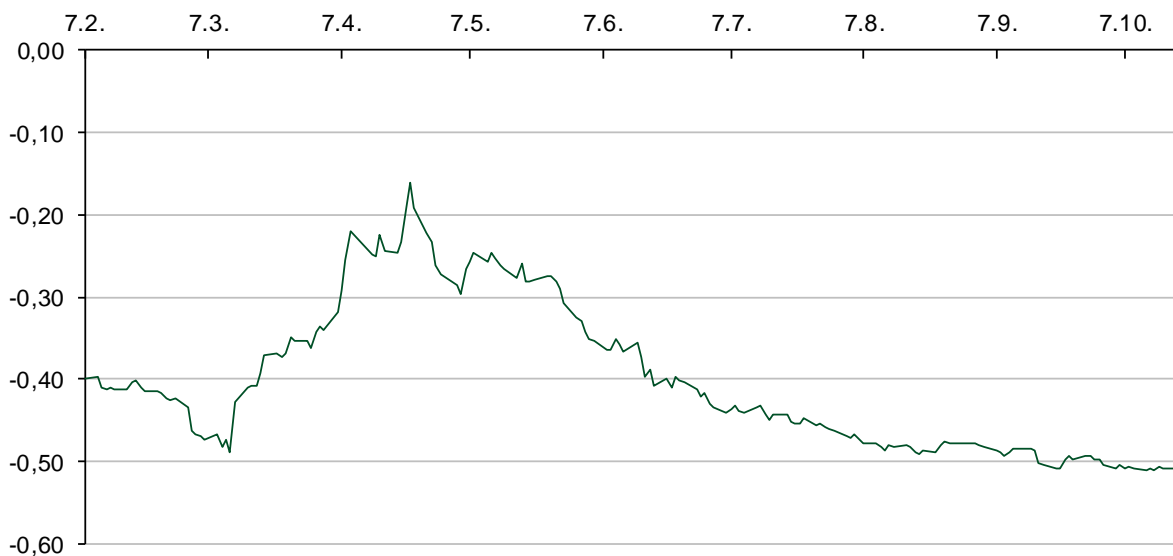
Vrijednost udjela fondova	19.10.2020
Fond	
PBZ START	143,9860 HRK
PBZ D-START	140,6729 USD
PBZ Short term bond	105,7698 HRK
PBZ Euro Short Term Bond	101,0791 EUR
PBZ Bond	141,9889 EUR
PBZ Conservative 10	121,4663 EUR
PBZ International Multi Asset	99,1131 EUR
PBZ Flexible 30	107,4901 EUR
PBZ Moderate 30	100,9187 EUR
PBZ Global	17,3111 EUR
PBZ Equity	11,7800 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mo)	Dat. Izdavanja	Dat. Dospjeća
364	HRK	0,06	415	22.10.2020	21.10.2021
364	EUR/VK	-0,05	147	22.10.2020	21.10.2021

	Kamatni sw apovi		
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0,5100	0,2070	-0,7725
2 Y	-0,5170	0,2340	-0,7200
3 Y	-0,5246	0,2770	-0,7250
4 Y	-0,4880	0,3460	-0,6825
5 Y	-0,4650	0,4340	-0,6325
6 Y	-0,4430	0,6970	-0,5800
7 Y	-0,3880	0,6140	-0,5275
8 Y	-0,3600	0,6970	-0,4750
9 Y	-0,3150	0,7750	-0,4250
10 Y	-0,2601	0,8460	-0,3800

Info tržišne kamate					
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Ask	0,20	0,20	0,20	0,25	0,30
EUR	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid	-0,70	-0,70	-0,65	-0,65	-0,60
Ask	0,01	0,01	0,01	0,01	0,05
USD	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid	0,01	0,01	0,01	0,05	0,10
Ask	0,30	0,35	0,35	0,45	0,55

Euribor 3M



Pregled tržišta obveznica

Obveznice Republike Hrvatske			Cijena		Prinos	
Naziv	Kupon	Dospijeće	Bid	Ask	Bid	Ask

Euro - Val. klauzula

RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	111,20	111,40	0,08	-0,02
RHMF-O-222E	0,500%	05.02.2022	100,15	100,45	0,38	0,15
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	120,35	121,05	0,24	0,07
RHMF-O-275E	0,750%	05.05.2027	100,25	101,25	0,71	0,55
RHMF-O-403E	1,250%	03.03.2040	96,50	97,50	1,46	1,40

HRK - Kunske

RHMF-O-217A	2,750%	08.07.2021	101,90	102,20	0,07	-0,35
RHMF-O-222A	2,250%	07.02.2022	102,70	103,00	0,16	-0,07
RHMF-O-23BA	1,750%	27.11.2023	104,40	105,10	0,32	0,10
RHMF-O-24BA	0,250%	27.11.2024	99,30	100,00	0,42	0,25
RHMF-O-253A	0,250%	03.03.2025	99,00	99,80	0,48	0,30
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	119,00	119,80	0,42	0,26
RHMF-O-26CA	4,250%	14.12.2026	122,10	122,90	0,58	0,46
RHMF-O-282A	2,875%	07.02.2028	115,10	116,00	0,74	0,63
RHMF-O-297A	2,375%	09.07.2029	112,70	113,60	0,86	0,76
RHMF-O-327A	3,250%	07.07.2032	122,70	123,70	1,17	1,09
RHMF-O-34BA	1,000%	27.11.2034	97,10	98,10	1,22	1,15

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	105,87	-0,58
Francuska	103,15	-0,31
Austrija	103,90	-0,41
Italija	108,83	0,74
Španjolska	110,46	0,20
Portugal	102,90	0,18
Češka	99,65	0,99
Grčka	105,98	0,85
Slovenija	103,76	-0,13

Eurobonds Rep. Hrvatske			Cijena		Prinos	
Naziv	Kupon	Dospijeće	Bid	Ask	Bid	Ask

Republika Hrvatska

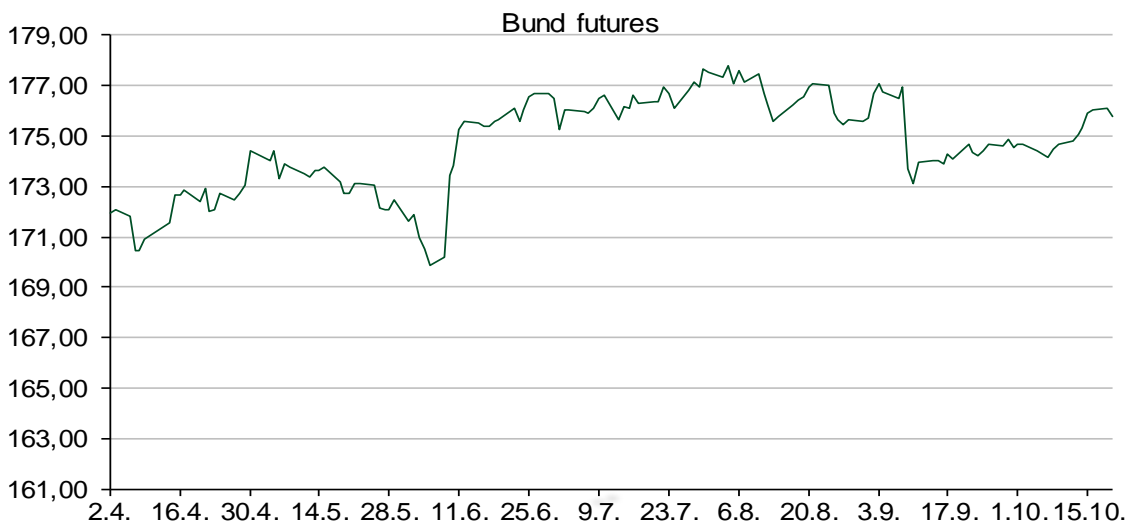
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	102,35	102,85	0,76	-0,40
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	106,00	106,20	0,12	0,00
CROATIA USD 2023	5,500%	04.04.2023	110,65	111,05	1,08	0,92
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	115,60	116,10	1,11	0,97
CROATIA EUR 2025	3,000%	11.03.2025	111,40	111,90	0,37	0,26
CROATIA EUR 2027	3,000%	20.03.2027	114,70	115,20	0,65	0,58
CROATIA EUR 2028	2,700%	15.06.2028	114,60	115,10	0,73	0,67
CROATIA EUR 2029	1,125%	19.06.2029	102,40	102,90	0,84	0,78
CROATIA EUR 2030	2,750%	27.01.2030	116,80	117,30	0,86	0,80
CROATIA EUR 2031	1,500%	17.06.2031	105,15	105,65	0,99	0,94

Hrvatske korporativne obveznice

ZG. HOLDING 2023 HRK	3,875%	15.07.2023	105,00	106,00	1,97	1,61
HEP USD	5,875%	23.10.2022	108,00	109,00	1,79	1,30

CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	28	47	74
Italija	49	89	125
Spain	18	38	58



Pregled dioničkog tržišta

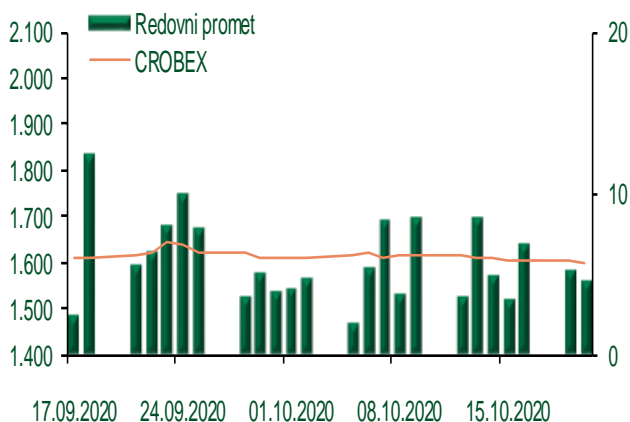
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 20.10.2020.

Ukupni promet ('000 HRK)	4.536,70
Redovni promet ('000 HRK)	4.536,70
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	0,00
Vrijednost CROBEX indeksa	1.598,81
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,26%
Promjena CROBEX indeksa u tekućoj godini	-20,75%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	999,59
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,22%
Promjena CROBEX10 indeksa u tekućoj godini	-16,69%

Izvor: Zagrebačka burza

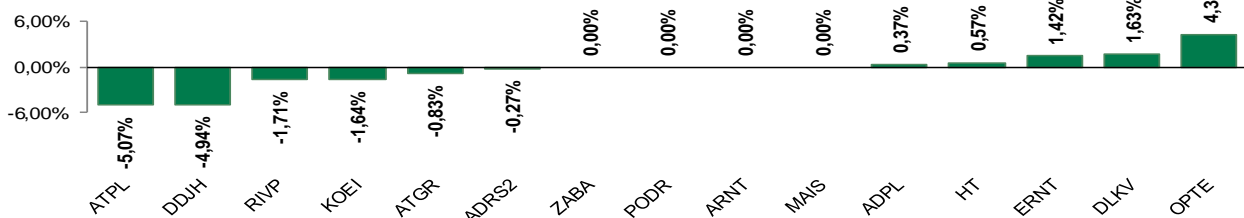
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 20.10.2020.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
ATPL	Atlantska plovidba d.d.	159,00	-5,07%	-57,60%	876,68	221,89
ATGR	Atlantic Grupa d.d.	1.200,00	-0,83%	-7,69%	745,20	4.001,16
OPTE	OT-optima telekom d.d.	4,84	4,31%	-39,12%	692,70	336,11
HT	Hrvatski Telekom d.d.	176,00	0,57%	0,57%	458,41	14.294,64
RVP	Valamar Riviera d.d.	23,00	-1,71%	-41,03%	438,48	2.898,63

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 20.10.2020.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	689,30	-0,07%	-14,02%
BELEXline	1.492,66	0,08%	-13,56%
SBI TOP	827,34	0,00%	-10,66%
SASX-10	784,30	0,25%	-3,04%
BIRS	602,67	-0,51%	-2,53%
MONEX 20	9.812,34	-0,01%	-13,95%
MBI-10	4.395,62	0,00%	-5,45%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 20.10.2020.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	5.889,22	0,08%	-21,92%
DAX 30	12.736,95	-0,92%	-3,86%
CAC 40	4.929,28	0,00%	-17,54%
DJIA	28.308,79	0,40%	-0,80%
NASDAQ	11.516,50	0,33%	28,35%
S&P 500	3.443,12	0,47%	6,57%
NIKKEI 225	23.639,46	0,31%	-0,07%

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.

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.