

# ABANKA

## POROČILO DEVIZNEGA TRGA

SEKTOR ZAKLADNIŠTVA | ODDELEK TRGOVANJA S STRANKAMI

ponedeljek, 31. avgust 2020, 08:27

Trenutni devizni tečaji		Δ %
EURUSD	1,1898	0,78
EURJPY	125,74	0,32
EURCHF	1,0754	-0,04
EURGBP	0,8926	-0,27
USDJPY	105,67	0,31
EURRUB	88,1790	0,13
GBPUSD	1,3328	-0,17

Terminski devizni tečaji			
	EURUSD	EURGBP	EURCHF
1M	1,1906	0,8929	1,0746
2M	1,1914	0,8931	1,0738
3M	1,1921	0,8932	1,0731
6M	1,1948	0,8941	1,0704
9M	1,1971	0,8946	1,0682
1Y	1,1995	0,8953	1,0665

Delniški indeksi		MTDΔ%	YTD Δ%
DOW	28653,87	8,42	0,40
NASDAQ	11695,63	8,84	30,35
XETRA DAX	13033,20	5,85	-1,63
CAC 40	5002,94	4,58	-16,31
TOPIX	1618,18	5,40	-3,27
HANG SENG	25524,63	3,36	-9,82
SHANGHAI	3418,55	2,83	11,60
RTS RUSSIA	1264,86	2,53	-18,29
SBI TOP	841,29	-0,33	-9,11
CROBEX	1606,72	2,09	-20,36

Blago in indeksi		
ZLATO Oz		\$1964,9241
Nafta BRENT Futures		\$46,11
Baltic Dry Index		1488
USD index		92,37

Ključne obrestne mere		
ZDA		0,25%
EMU		0,00%
ŠVICA		-0,75%
VB		0,10%

Obrestne zamenjave (IRS)		EUR	USD	CHF
2Y		-0,43	0,23	-0,63
3Y		-0,42	0,24	-0,60
4Y		-0,39	0,29	-0,55
5Y		-0,37	0,34	-0,48
6Y		-0,33	0,43	-0,44
7Y		-0,28	0,50	-0,38
8Y		-0,24	0,59	-0,31
10Y		-0,14	0,73	-0,23
15Y		0,07	0,95	-0,04

**Devizni komentar** Miloš Pelcar

Odstop japonskega premierja je povzročil zvišanje vrednosti jena, saj so vlagatelji, kot vedno v času večje negotovosti, okrepili naložbe v japonske jene. Javnomenjske ankete kažejo največjo podporo javnosti kritiku Abejeve ekonomske politike in bivšemu obrambnemu ministru Shiberuju Ishibi. Tečaj EURJPY je sprva izgubil dober odstotek vrednosti, tečaj USDJPY pa se je približal mesečnemu dnu. Jen je nekaj vrednosti izgubil šele ob novici, da je več vplivnežev v vladajoči stranki podprlo trenutnega vodjo kabineta vlade Yoshida Suga. Kljub zvišanju donosov dolgoročnejših ameriških državnih obveznic se je nadaljevalo drsenje dolarja. Očitno analitiki ocenjujejo, da se kratkoročni donosi še ne bodo zvišali. Morda bo kaj več podrobnosti o zasuku v politiki centralne banke danes ob 15. uri sporočil član sveta FED-a Richard Clarida.

### Današnje objave in dogodki

			napoved	prej
10:00	EUR	ITA - Gross Domestic Product (YoY)(Q2)	-17,3%	-17,3%
14:00	EUR	Harmonized Index of Consumer Prices (YoY)(Aug) Prel	0,4%	0%
15:00	USD	Fed's Clarida speech		

### Graf dneva: EUR/JPY



### Medbančne obrestne mere

	ON	1 ted.	1 mes.	2 mes.	3 mes.	6 mes.	9 mes.	1 leto	5 let	10 let
€STR	-0,552	-	-	-	-	-	-	-	-	-
EUR	-0,55	-0,60	-0,60	-0,57	-0,48	-0,51	-0,47	-0,47	-0,65	-0,41
SEK	-0,25	-0,24	-0,21	-0,25	-0,17	-0,24	-0,17	0,01	-0,263	0,02
CHF	-0,93	-0,80	-0,75	-0,78	-0,75	-0,71	-0,64	-0,58	-0,67	-0,42
GBP	0,01	0,01	0,05	0,05	0,05	0,1	0,15	0,20	-0,005	0,31
JPY	-0,30	-0,01	-0,07	-0,03	-0,03	-0,09	-0,05	-0,01	-0,07	0,05
USD	0,05	0,08	0,05	0,06	0,20	0,3	0,23	0,40	0,2736	0,72
EURIBOR		-0,538	-0,523	-	-0,477	-0,444	-	-0,369	-	-

### Dodatne informacije

		sales@abanka.si
Miha Zavodnik	01/ 4718 215	
Miloš Pelcar	01/ 4718 200	
Katja Pleško Štrubelj	01/ 47 18 211	
Gregor Hudobivnik	01/ 4718 203	
Božica Filipič	01/ 4718 218	

Donosi obveznic		
<b>Evropa</b>		
1M DE BUBIL		-0,540
3M DE BUBIL		-0,520
6M DE BUBIL		-0,583
1Y DE BUBIL		-0,549
2Y DE BUND		-0,659
3Y DE BUND		-0,694
4Y DE BUND		-0,690
5Y DE BUND		-0,654
6Y DE BUND		-0,640
7Y DE BUND		-0,562
8Y DE BUND		-0,549
9Y DE BUND		-0,482
10Y DE BUND		-0,414
15Y DE BUND		-0,188
20Y DE BUND		-0,137
30Y DE BUND		0,064

ZDA		
1M T-BILL		0,101
3M T-BILL		0,117
6M T-BILL		0,122
5Y T-NOTE		0,274
10Y T-NOTE		0,721
30Y T-BOND		1,498

Velika Britanija		
1M T-BILL		0,055
3M T-BILL		0,018
6M T-BILL		0,032
1Y GILT		0,025
2Y GILT		-0,051
3Y GILT		-0,078
4Y GILT		-0,062
5Y GILT		-0,005
6Y GILT		0,026
8Y GILT		0,172
10Y GILT		0,313
15Y GILT		0,567
20Y GILT		0,759
30Y GILT		0,887

### Vir podatkov



### Abanka d.d.

Slovenska 58. 1517 Ljubljana  
www.abanka.si

Izjava o omejitvi odgovornosti: Vsi podatki v poročilu so informativni. Abanka d.d. ne sprejema obveznosti za izgube, do katerih bi prišlo z uporabo teh podatkov, ali izgube, ki bi na kakršenkoli drugačen način izhajale iz povezav z navedenimi podatki. Izražena mnenja avtorjev deviznega komentarja ne odražajo nujno mnenja Abanke d.d. V kolikor poročila ne želite več prejemati nam lahko pišete na: sales@abanka.si.