

# Dnevni izvještaj financijskih tržišta

29.prosinac 2015.

# Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,0978	1,0980
EURCHF	1,0842	1,0844
EURGBP	0,7382	0,7384
EURJPY	132,24	132,30
GBPUSD	1,4871	1,4873
USDJPY	120,44	120,45
GOLD	1071,05	1071,25
BRENT	36,28	36,30

	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	1,3	2,8
T/N	1,3	2,8
1W	9	19
2W	21	42
1M	43	99
3M	126	318
6M	156	858
12M	463	1852

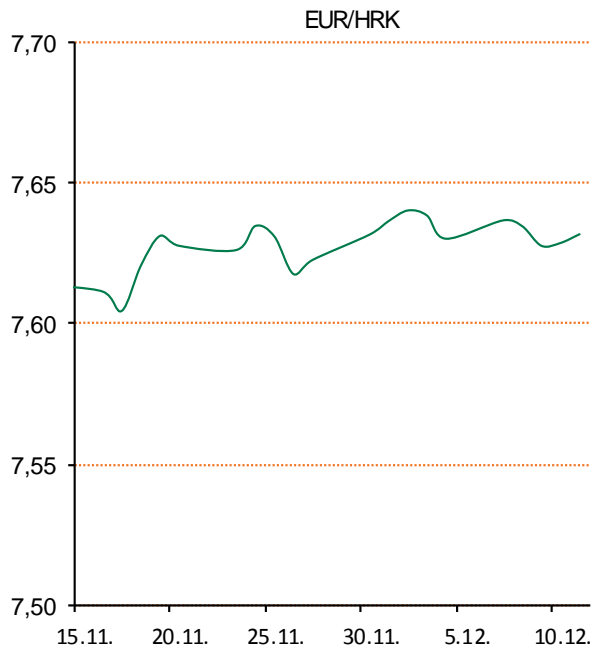
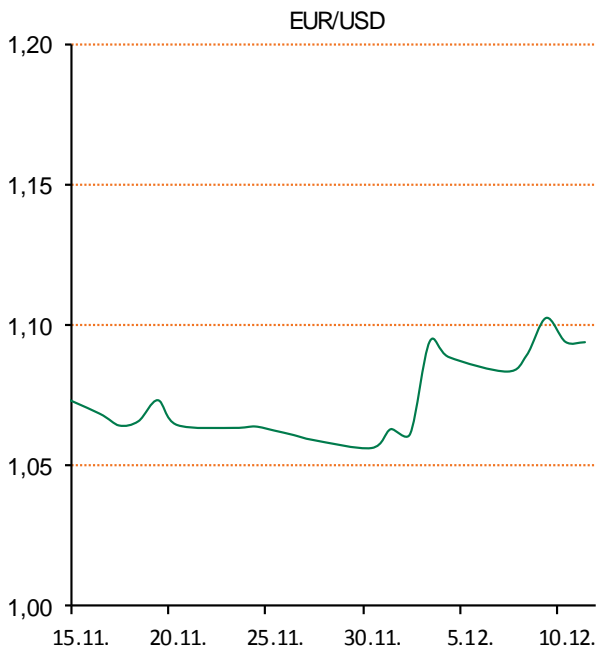
	Interest rate swap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,0688	-0,0388
2Y	-0,0425	-0,0125
3Y	0,0377	0,0877
4Y	0,182	0,192
5Y	0,311	0,341
7Y	0,59	0,6
9Y	0,831	0,861
10Y	0,951	0,961

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,6100	7,6600
USDHRK	6,9308	6,9776
CHFHRK	7,0177	7,0651
GBPHRK	10,3061	10,3766
JPYHRK	5,7521	5,7925
AUDHRK	5,0384	5,0728
CADHRK	4,9800	5,0187
NOKHRK	0,7994	0,8052
DKKHRK	1,0197	1,0265
SEKHRK	0,8294	0,8355
HUFHRK	2,4221	2,4407
PLNHRK	1,7927	1,8057
CZKHRK	0,2813	0,2835

**SRETAN BOŽIĆ I NOVA GODINA!**  
**BUON NATALE E FELICE ANNO NUOVO!**  
**MERRY CHRISTMAS AND A HAPPY NEW YEAR!**



**PRIVREDNA BANKA ZAGREB**  
PBZ je član grupe INTESA  SANPAOLO



# Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamratne stope na dan			28.12.2015	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	0,3671	-0,787	-	0,64	
1W	0,3897	-0,848	-0,230	0,67	
2W			-0,226	0,75	
1M	0,4219	-0,805	-0,199	0,94	
3M	0,6031	-0,770	-0,131	1,14	
6M	0,8273	-0,702	-0,040	1,43	
1Y	1,1475	-0,610	0,060	1,83	

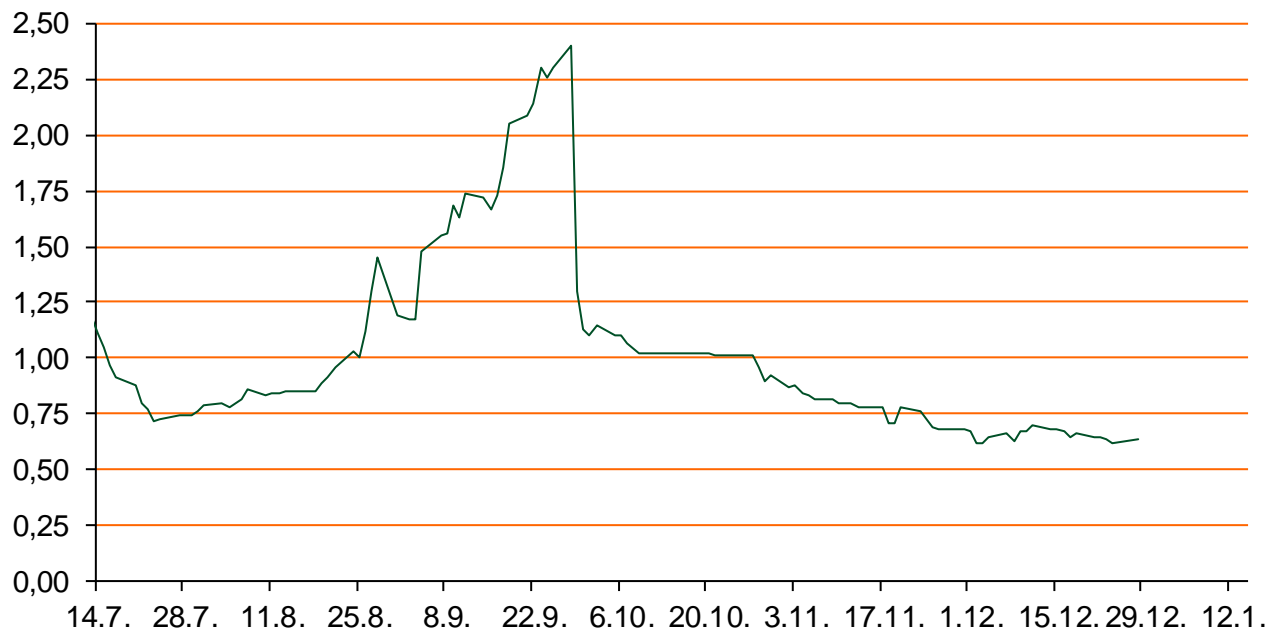
Vrijednost udjela fondova		28.12.2015
Fond		
PBZ Novčani fond		143,0571 HRK
PBZ Euro novčani		139,1022 EUR
PBZ Dollar		131,1278 USD
PBZ Short term bond		99,8701 HRK
PBZ Bond		123,4225 EUR
PBZ Conservative 10		104,7846 EUR
PBZ Flexibile 30		99,3546 EUR
PBZ Global		14,3309 EUR
PBZ Equity		10,1463 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospjeća
91	HRK	0,43	100	10.12.2015	10.03.2016
182	HRK	0,55	100	10.12.2015	08.12.2016
364	HRK	1,47	1266	10.12.2015	08.12.2016
546	EUR	1,95	1225	12.02.2015	11.08.2016
91	EUR/VK	0,20	11,00	26.11.2015	25.02.2015
364	EUR/VK	0,40	2,60	10.12.2015	08.12.2016

	Kamatni sw apovi		
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0,0600	-	-
2 Y	-0,0300	1,1390	-0,7050
3 Y	0,0437	1,3790	-0,6142
4 Y	0,1855	1,5600	-0,5067
5 Y	0,3090	1,7060	-0,3717
6 Y	0,4565	1,8310	-0,2367
7 Y	0,5870	1,9350	-0,1117
8 Y	0,7050	2,0230	0,0205
9 Y	0,8395	2,1000	0,1205
10 Y	0,9485	2,1680	0,1858

PBZ Referente kamate na HRK					
	O/N	1W	2W	1M	3M
Bid	0,0000	0,1000	0,2000	0,5000	0,7000
Ask	0,5000	0,6000	0,7000	1,0000	1,2000

Zibor na O/N



# Pregled tržišta obveznica

## Obveznice Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Euro - Val. klauzula</i>						
RHMF-O-19BA	5,375%	29.11.2019	109,85	110,35	2,70	2,57
RHMF-O-203E	6,500%	05.03.2020	114,75	115,45	2,74	2,57
RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	116,24	116,94	3,69	3,58
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	112,85	113,55	3,96	3,87
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-167A	5,750%	22.07.2016	102,10	102,60	1,94	1,06
RHMF-O-172A	4,750%	08.02.2017	102,75	103,25	2,21	1,76
RHMF-O-17BA	6,250%	25.11.2017	106,85	107,35	2,53	2,27
RHMF-O-187A	5,250%	10.07.2018	105,95	106,95	2,79	2,40
RHMF-O-203A	6,750%	05.03.2020	113,50	114,50	3,26	3,00
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	103,40	104,40	4,07	3,93
RHMF-O-26CA	4,250%	14.12.2026	0,00	1,00	#BROJ!	379,71

## Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	103,87	0,59
Francuska	100,57	0,94
Austrija	103,19	0,86
Italija	103,72	1,60
Španjolska	103,24	1,79
Portugal	103,38	2,48
Češka	104,10	0,60
Grčka	70,59	8,22
Slovenija	132,00	1,70

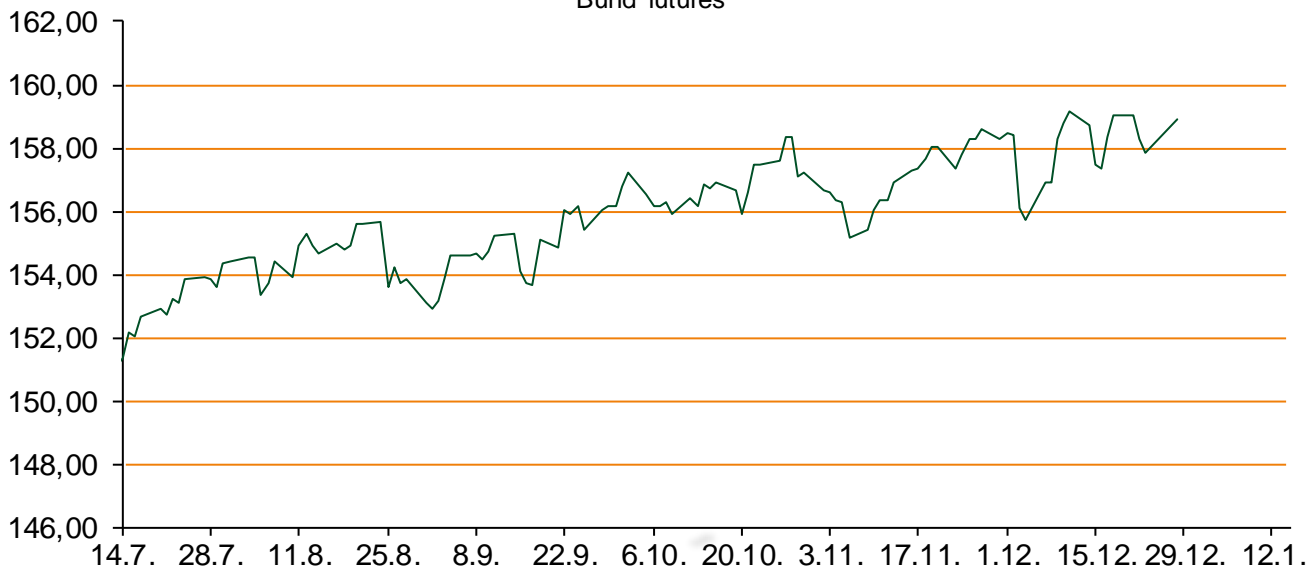
## Eurobonds Rep. Hrvatske i hrvatskih kompanija

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA USD 2017	6,250%	27.04.2017	103,60	104,10	3,43	3,05
CROATIA EUR 2018	5,875%	09.07.2018	108,75	109,25	2,26	2,06
CROATIA USD 2019	6,750%	05.11.2019	107,05	107,55	4,72	4,58
CROATIA USD 2020	6,625%	14.07.2020	107,00	108,00	4,88	4,65
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	105,95	106,95	5,06	4,85
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	99,75	100,75	3,92	3,74
CROATIA USD 2023	5,5%	04.04.2023.	101,20	102,20	5,30	5,13
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	103,85	104,85	5,40	5,25
CROATIA EUR 2025	3,000%	09.03.2025	90,60	91,10	4,26	4,19
<i>Hrvatske kompanije</i>						
AGROKOR 2020	9,125%	10.10.2020	106,90	107,90	7,14	6,87
AGROKOR 2019	9,875%	01.05.2019	106,90	107,90	7,49	7,16
ZG. HOLDING 2017	5,500%	10.07.2017	94,00	95,00	9,89	9,12
HEP USD	6,000%	09.11.2017	105,60	106,60	2,87	2,34
HEP USD	5,875%	23.10.2022	101,20	102,20	5,66	5,48

## CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	150	239	301
Italija	34	70	99
Spain	29	63	90

Bund futures



# Pregled dioničkog tržišta

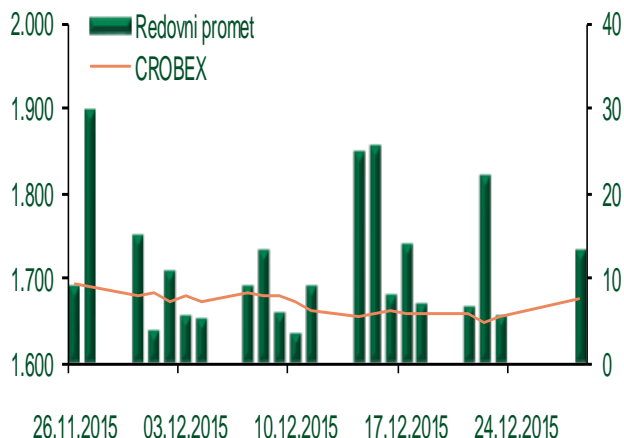
## Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 28.12.2015.

Ukupni promet ('000 HRK)	13.175,35
Redovni promet ('000 HRK)	13.175,35
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	294.717,96
<b>Vrijednost CROBEX indeksa</b>	<b>1.675,88</b>
Dnevna promjena CROBEX indeksa	1,21%
Promjena CROBEX indeksa u 2015.	-3,99%
<b>Vrijednost CROBEX10 indeksa</b>	<b>990,31</b>
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	1,06%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2015.	-1,67%

Izvor: Zagrebačka burza

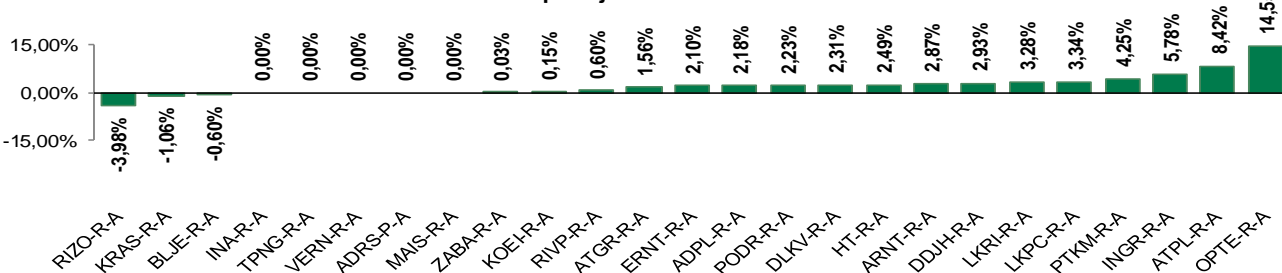
## Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



## Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 28.12.2015.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	143,90	2,49%	-4,39%	2.213,10	11.783,76
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	23,50	0,60%	18,27%	1.318,48	2.961,65
GRNL-R-A	Granolio d.d.	145,00	17,89%	4,54%	1.250,13	275,74
PODR-R-A	Podravka d.d.	327,51	2,23%	11,60%	979,39	1.775,11
ATGR-R-A	Atlantic grupa d.d.	828,20	1,56%	-11,89%	577,19	2.761,47

## Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



## Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 28.12.2015.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	624,66	0,26%	-6,35%
BELEXline	1.345,17	0,02%	0,03%
SBI TOP	692,40	0,32%	-11,68%
SASX-10	687,54	0,00%	-3,81%
BIRS	661,23	1,06%	-8,33%
MONEX 20	11.623,13	-0,43%	2,35%
MBI-10	1.807,97	0,47%	-1,96%

Izvor: službene stranice burzi regije

## Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 28.12.2015.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	6254,64	+0,22%	-4,74%
DAX 30	10653,91	-0,69%	8,65%
CAC 40	4617,95	-0,97%	8,08%
DJIA	17528,27	-0,14%	-1,65%
NASDAQ	5040,98	-0,15%	6,44%
S&P 500	2056,5	-0,22%	-0,12%
NIKKEI 225	18982,23	+0,58%	8,78%

Izvor: Bloomberg

# Kontakti

Sektor poslova Riznice	<a href="mailto:treasury@pbz.hr">treasury@pbz.hr</a>
Direkcija prodaje	01 4891 301
Direkcija likvidnosti	01 4891 303
Direkcija trgovanja	
-Trgovanje devizama	01 4891 302
-Trgovanje vrijednosnim papirima	01 4891 304
-Trgovanje efektivom	01 4891 305
Sektor investicijskog bankarstva	<a href="mailto:brokeri@pbz.hr">brokeri@pbz.hr</a>
Direkcija brokerskih poslova	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 pouzda, 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.