

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

08.siječanj 2016.

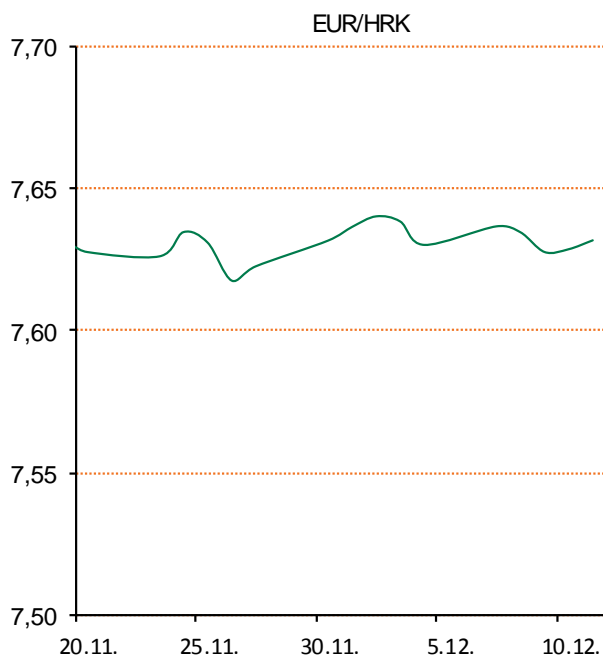
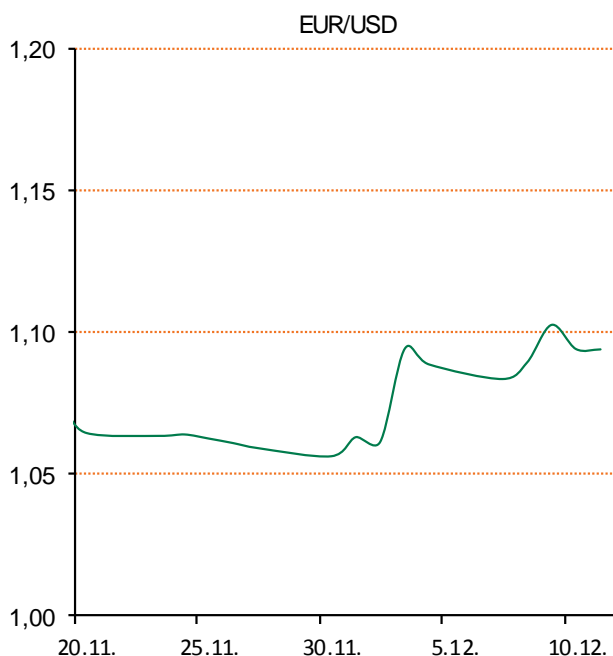
Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,0865	1,0868
EURCHF	1,0855	1,0857
EURGBP	0,7434	0,7435
EURJPY	128,56	128,61
GBPUSD	1,4615	1,4618
USDJPY	118,29	118,34
GOLD	1099,95	1101,45
BRENT	34,54	34,56

	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	3,8	8,3
T/N	1,3	2,8
1W	9	19
2W	21	42
1M	43	99
3M	126	319
6M	156	859
12M	464	1854

	Interest rate sw ap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,1044	-0,0644
2Y	-0,081	-0,075
3Y	-0,003	0,0019
4Y	0,115	0,12
5Y	0,2525	0,2575
7Y	0,52	0,55
9Y	0,782	0,812
10Y	0,9	0,92

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,6100	7,6600
USDHRK	7,0022	7,0502
CHFHRK	7,0093	7,0567
GBPHRK	10,2354	10,3040
JPYHRK	5,9171	5,9583
AUDHRK	4,9380	4,9714
CADHRK	4,9657	5,0016
NOKHRK	0,7884	0,7938
DKKHRK	1,0201	1,0269
SEKHRK	0,8233	0,8290
HUFHRK	2,4207	2,4389
PLNHRK	1,7533	1,7660
CZKHRK	0,2813	0,2835



Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamatne stope na dan			07.01.2016	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	0,3661	-0,762	-	0,63	
1W	0,38715	-0,822	-0,261	0,72	
2W			-0,249	0,76	
1M	0,4235	-0,789	-0,218	0,95	
3M	0,6201	-0,748	-0,142	1,17	
6M	0,8513	-0,682	-0,050	1,45	
1Y	1,16535	-0,602	0,051	1,85	

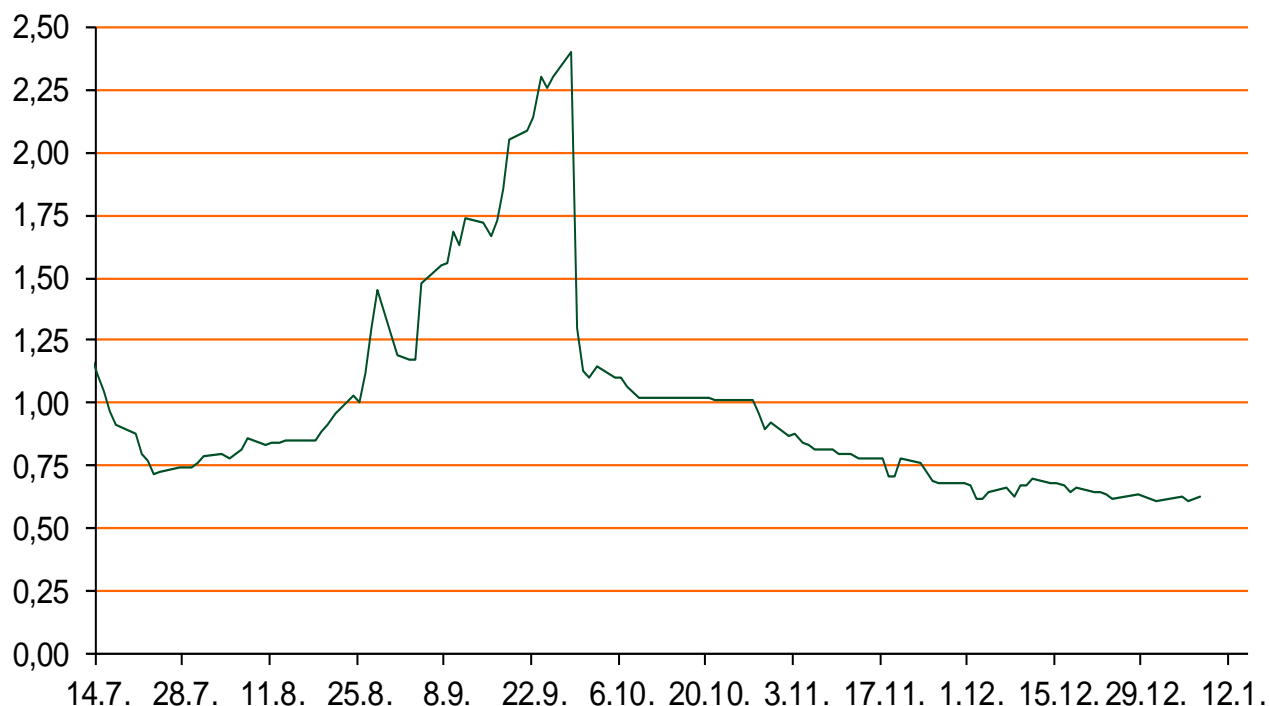
Vrijednost udjela fondova	05.01.2016
Fond	
PBZ Novčani fond	143,0697 HRK
PBZ Euro novčani	139,1104 EUR
PBZ Dollar	131,1511 USD
PBZ Short term bond	100,2325 HRK
PBZ Bond	123,7832 EUR
PBZ Conservative 10	104,8430 EUR
PBZ Flexibile 30	99,3299 EUR
PBZ Global	14,2503 EUR
PBZ Equity	10,1915 EUR

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	-0,0975	-	-
2 Y	-0,0925	1,0770	-0,6840
3 Y	-0,0160	1,2870	-0,6210
4 Y	0,1100	1,4540	-0,5140
5 Y	0,2520	1,5950	-0,3890
6 Y	0,3800	1,7180	-0,2460
7 Y	0,5200	1,8290	-0,1290
8 Y	0,6540	1,9230	-0,0240
9 Y	0,7810	2,0040	0,0740
10 Y	0,8940	2,0750	0,1610

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	109,90	110,40	2,67	2,54
RHMF-O-203E	6,500%	05.03.2020	114,80	115,50	2,70	2,53
RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	116,45	117,15	3,64	3,53
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	113,00	113,70	3,93	3,84
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-167A	5,750%	22.07.2016	102,00	102,50	1,90	0,96
RHMF-O-172A	4,750%	08.02.2017	102,80	103,30	2,09	1,63
RHMF-O-17BA	6,250%	25.11.2017	106,95	107,45	2,42	2,15
RHMF-O-187A	5,250%	10.07.2018	106,10	107,10	2,70	2,30
RHMF-O-203A	6,750%	05.03.2020	113,50	114,50	3,24	2,97
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	#####	#####	-42,55	#BROJ!
RHMF-O-26CA	4,250%	14.12.2026	101,15	102,15	4,12	4,00

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	104,21	0,55
Francuska	100,77	0,92
Austrija	103,24	0,85
Italija	104,10	1,56
Španjolska	103,62	1,74
Portugal	102,23	2,61
Češka	103,70	0,63
Grčka	68,26	8,71
Slovenija	132,93	1,60

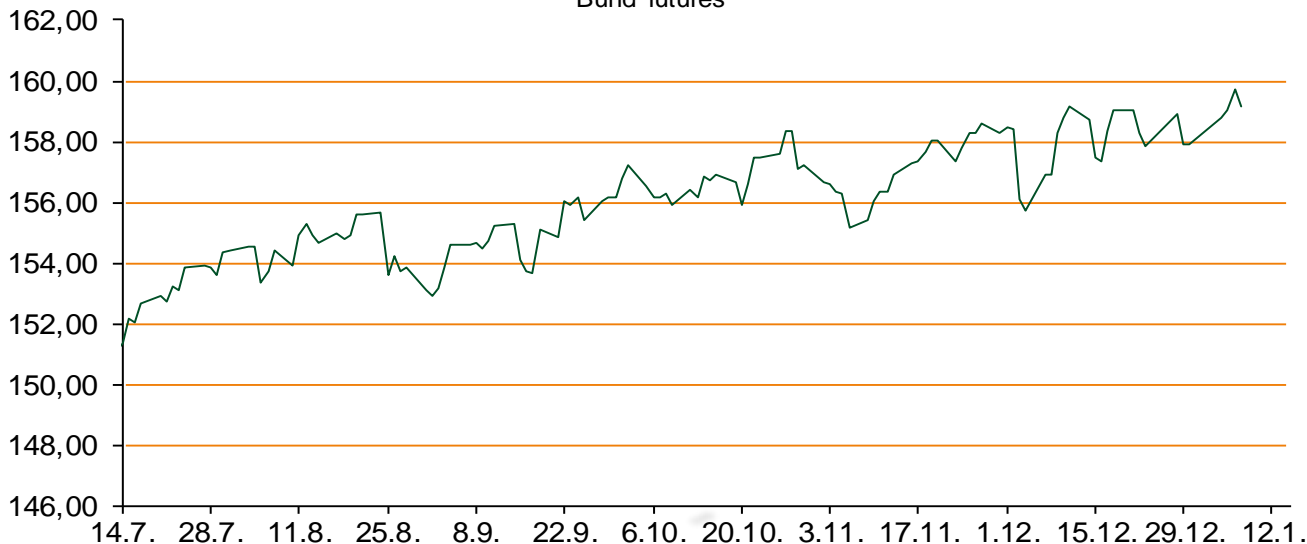
Eurobonds Rep. Hrvatske i hrvatskih kompanija

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	3,36	2,97
CROATIA EUR 2018	5,875%	09.07.2018	108,80	109,30	2,19	2,00
CROATIA USD 2019	6,750%	05.11.2019	107,35	107,85	4,62	4,48
CROATIA USD 2020	6,625%	14.07.2020	107,40	108,40	4,78	4,54
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	106,80	107,80	4,88	4,67
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	100,60	101,60	3,76	3,59
CROATIA USD 2023	5,5%	04.04.2023	102,10	103,10	5,15	4,98
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	105,00	106,00	5,23	5,08
CROATIA EUR 2025	3,000%	09.03.2025	91,70	92,20	4,11	4,04
<i>Hrvatske kompanije</i>						
AGROKOR 2020	9,125%	10.10.2020	106,50	107,50	7,24	6,97
AGROKOR 2019	9,875%	01.05.2019	106,90	107,90	7,47	7,14
ZG. HOLDING 2017	5,500%	10.07.2017	94,00	95,00	9,98	9,20
HEP USD	6,000%	09.11.2017	105,60	106,60	2,82	2,28
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	141	243	310
Italija	30	69	101
Spain	30	69	95

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

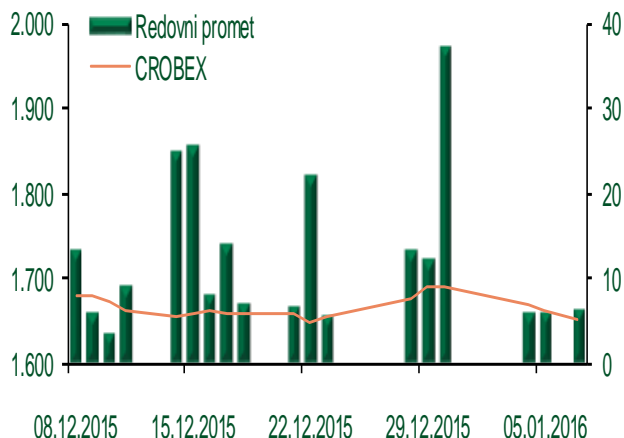
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 07.01.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	6.265,68
Redovni promet ('000 HRK)	6.265,68
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	16.051,65
Vrijednost CROBEX indeksa	1.649,99
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,71%
Promjena CROBEX indeksa u 2015.	-2,35%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	966,41
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,91%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2015.	-2,31%

Izvor: Zagrebačka burza

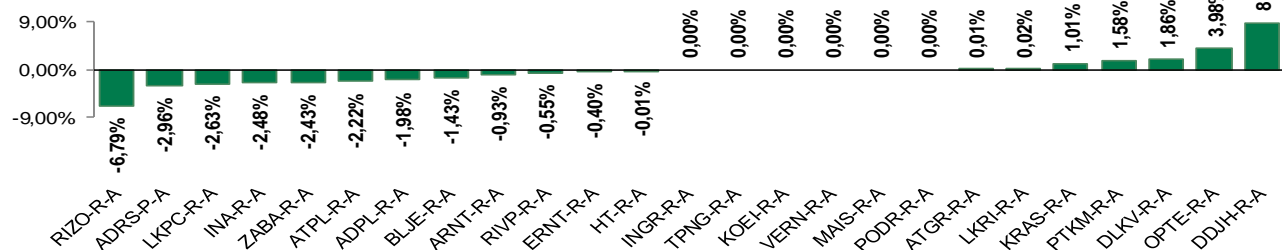
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 07.01.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
LEDO-R-A	Ledo d.d.	9.000,00	0,55%	-0,38%	2.466,00	1.981,53
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	141,01	-0,01%	-2,35%	1.195,64	11.547,10
DDJH-R-A	Đuro Đaković Holding d.d.	28,54	8,85%	6,14%	496,19	92,39
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	23,63	-0,55%	-1,83%	301,52	2.978,03
KRAS-R-A	Kraš d.d.	500,00	1,01%	1,01%	289,27	686,81

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 07.01.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	634,92	-0,01%	-1,43%
BELEXline	1.364,50	-0,14%	-1,15%
SBI TOP	684,96	-1,50%	-1,60%
SASX-10	697,27	0,86%	-0,25%
BIRS	658,66	-0,04%	-0,05%
MONEX 20	12.128,07	1,00%	0,00%
MBI-10	1.827,30	0,00%	-0,33%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 07.01.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	5954,08	-1,96%	-4,62%
DAX 30	9979,85	-2,29%	-7,10%
CAC 40	4403,58	-1,72%	-5,04%
DJIA	16514,1	-2,32%	-5,23%
NASDAQ	4689,43	-3,03%	-6,35%
S&P 500	1943,09	-2,37%	-4,93%
NIKKEI 225	17697,96	-0,39%	-3,47%

Izvor: Bloomberg

Kontakti

Riznica i upravljanje aktivom i pasivom
treasury@pbz.hr

-Izvršenje naloga klijenata	01 4891 301
-Likvidnost	01 4891 303
-Trgovanje devizama	01 4891 302
-Trgovanje vrijednosnim papirima	01 4891 304
-Trgovanje efektivom	01 4891 305

Sektor investicijskog bankarstva

brokeri@pbz.hr

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.