

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

23. prosinac 2016.

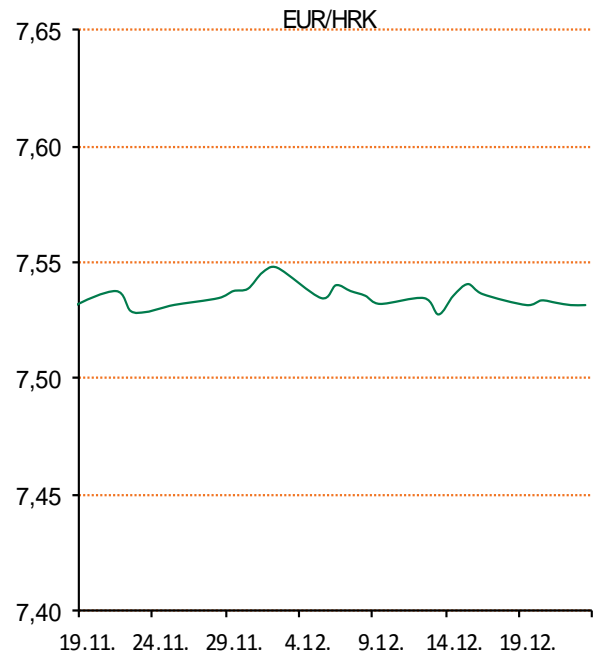
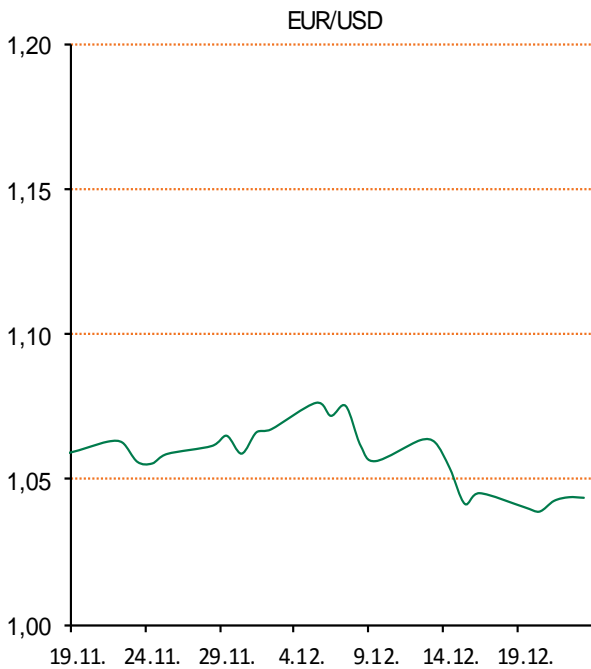
Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,0444	1,0446
EURCHF	1,0722	1,0727
EURGBP	0,8518	0,8520
EURJPY	122,58	122,62
GBPUSD	1,2261	1,2265
USDJPY	117,38	117,39
GOLD	1131,65	1132,45
BRENT	53,98	54,00

	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	0,2	5
T/N	0,3	6,7
1W	0	13
2W	3	29
1M	20	73
3M	81	248
6M	114	552
12M	303	1177

	Interest rate swap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,21	-0,16
2Y	-0,153	-0,141
3Y	-0,1095	-0,0595
4Y	-0,013	0,017
5Y	0,097	0,127
7Y	0,346	0,376
9Y	0,602	0,612
10Y	0,7	0,73

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,5100	7,5600
USDHRK	7,1894	7,2386
CHFHRK	7,0010	7,0509
GBPHRK	8,8146	8,8753
JPYHRK	6,1246	6,1674
AUDHRK	5,1829	5,2178
CADHRK	5,3274	5,3659
NOKHRK	0,8248	0,8308
DKKHRK	1,0102	1,0170
SEKHRK	0,7789	0,7843
HUFHRK	2,4205	2,4382
PLNHRK	1,7021	1,7148
CZKHRK	0,2776	0,2798



Pregled novčanog tržišta

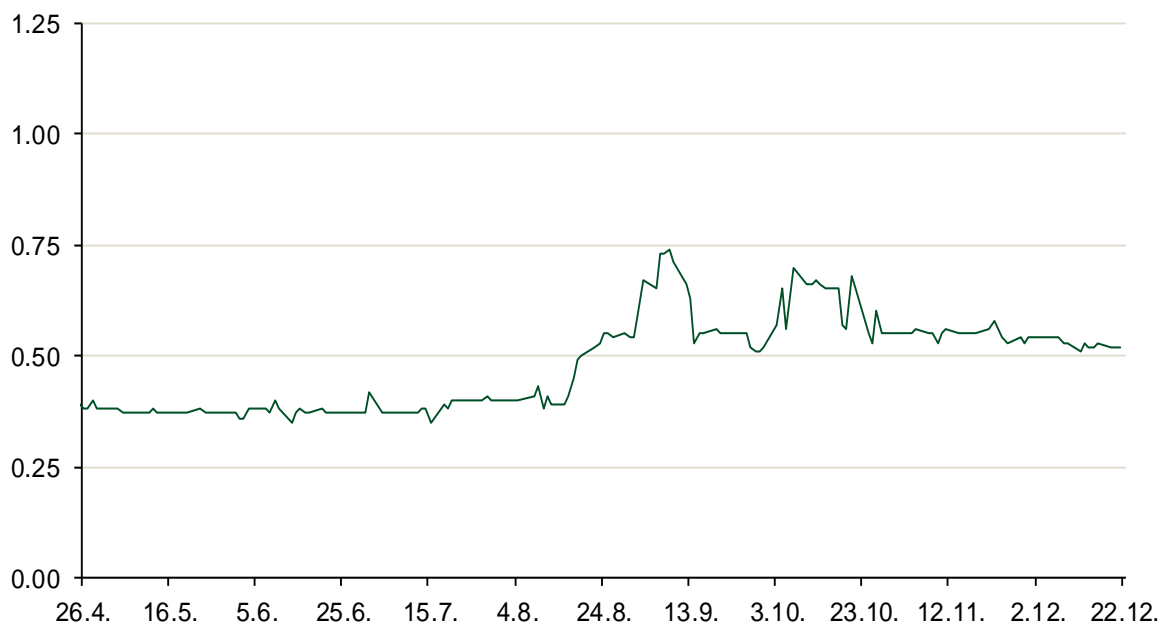
Referentne kamatne stope na dan					Vrijednost udjela fondova	
Opis	22.12.2016			21.12.2016		
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	0.686	-0.794	-	0.52	PBZ Novčani fond	143,4599 HRK
1W	0.70778	-0.804	-0.374	0.53	PBZ Euro novčani	139,3433 EUR
2W			-0.371	0.58	PBZ Dollar	132,5156 USD
1M	0.755	-0.822	-0.369	0.68	PBZ Short term bond	102,2621 HRK
3M	0.99761	-0.739	-0.316	0.85	PBZ Bond	130,8600 EUR
6M	1.316	-0.669	-0.216	0.98	PBZ Conservative 10	111,3848 EUR
1Y	1.68956	-0.504	-0.082	1.28	PBZ Flexibile 30	101,3973 EUR
					PBZ Global	15,5656 EUR
					PBZ Equity	11,6614 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospjeća
364	HRK	0.65	1068	08.12.2016	07.12.2017
364	EUR/VK	0.17	29	27.10.2016	26.10.2017
455	EUR	0.70	1500	11.08.2016	09.11.2017

	Kamatni sw apovi		
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.2100	1.2050	-0.6950
2 Y	-0.1600	1.4960	-0.6110
3 Y	-0.1100	1.7370	-0.5250
4 Y	-0.0075	1.9210	-0.4170
5 Y	0.1000	2.0630	-0.2990
6 Y	0.2340	2.1740	-0.1870
7 Y	0.3500	2.2620	-0.0780
8 Y	0.4800	2.3360	0.0180
9 Y	0.5900	2.3970	0.1060
10 Y	0.7000	2.4480	0.1850

PBZ Referente kamate						
	HRK	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid		0.00	0.00	0.10	0.20	0.30
Ask		0.50	0.50	0.60	0.70	0.80
	EUR	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid		0.00	0.00	0.00	0.01	0.01
Ask		0.20	0.20	0.30	0.41	0.51
	USD	O/N	1W	1M	3M	6M
Bid		0.40	0.50	0.70	0.90	1.00
Ask		1.00	1.10	1.30	1.50	1.60

Zibor na O/N



Pregled tržišta obveznica

Obveznice Republike Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Euro - Val. klauzula</i>						
RHMF-O-19BA	5.375%	29.11.2019	111.70	112.40	1.28	1.06
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	115.85	116.55	1.40	1.19
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	120.00	120.70	2.62	2.50
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	118.25	118.95	3.02	2.93
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-172A	4.750%	08.02.2017	100.55	100.75	0.04	-1.63
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	105.00	105.50	0.74	0.21
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	106.15	106.65	1.20	0.89
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	115.25	116.25	1.80	1.49
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	102.10	103.10	2.26	2.03
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	110.80	111.80	3.05	2.92
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	109.95	110.95	3.08	2.96

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	97.62	0.25
Francuska	95.41	0.73
Austrija	102.57	0.48
Italija	94.93	1.82
Španjolska	99.39	1.37
Portugal	92.99	3.76
Češka	104.82	0.48
Grčka	76.58	7.27
Slovenija	137.53	0.88

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA USD 2017	6.250%	27.04.2017	101.30	101.80	2.29	0.81
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	108.30	108.80	0.42	0.12
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.00	108.50	3.77	3.59
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	108.50	109.00	4.03	3.88
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	108.65	109.15	4.13	4.01
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	107.25	107.75	2.43	2.33
CROATIA USD 2023	5.5%	04.04.2023.	105.30	105.80	4.52	4.43
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	108.00	108.50	4.66	4.58
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	100.45	100.95	2.94	2.87

CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	51	135	213
Italija	77	126	163
Spain	29	54	79

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	103.60	104.60	7.79	7.43
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	103.20	104.20	8.33	7.87
ZG. HOLDING 2023 HRK	3.875%	15.07.2023	102.75	103.75	3.40	3.23
HEP USD	6.000%	09.11.2017	103.00	104.50	2.48	0.78
HEP USD	5.875%	23.10.2022	106.10	107.10	4.66	4.47

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

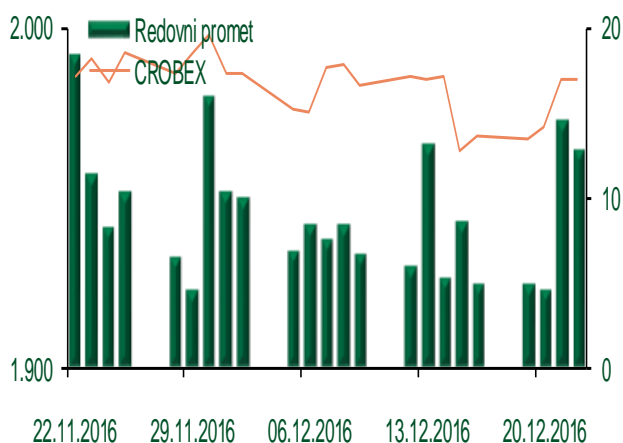
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 22.12.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	15.596,05
Redovni promet ('000 HRK)	12.836,05
Prijavljeni promet ('000 HRK)	2.760,00
OTC promet ('000 HRK)	104.455,24
Vrijednost CROBEX indeksa	1.984,25
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,01%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	17,44%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.162,60
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,18%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	17,52%

Izvor: Zagrebačka burza

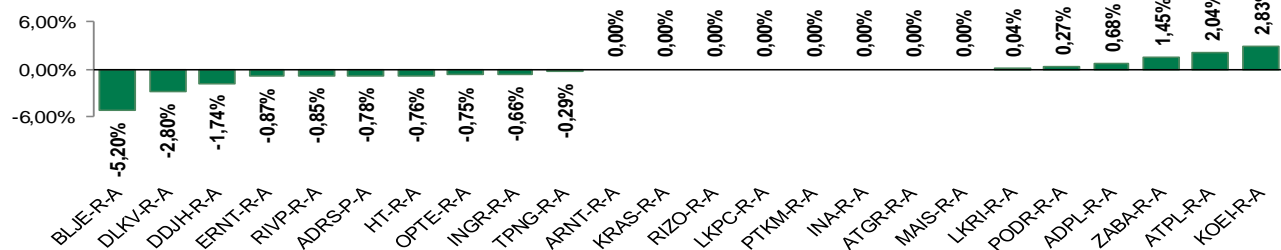
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 22.12.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	176,65	-0,76%	22,33%	2.722,67	14.465,61
JMNC-R-A	Jamnica d.d.	138.000,00	0,00%	20,11%	1.104,00	3.053,39
ADPL-R-A	AD Plastik d.d.	137,99	0,68%	40,15%	330,51	579,50
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	33,96	-0,85%	41,09%	290,58	4.279,90
VDKT-R-A	Viadukt d.d.	310,50	1,44%	1,82%	256,32	141,84

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 22.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	720,53	-0,23%	11,87%
BELEXline	1.575,78	-0,11%	14,15%
SBI TOP	701,68	-0,22%	0,80%
SASX-10	666,93	0,89%	-4,59%
BIRS	568,87	-0,15%	-13,68%
MONEX 20	11.085,92	0,41%	-8,59%
MBI-10	2.162,52	0,22%	17,96%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 22.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7063,68	+0,32%	13,16%
DAX 30	11456,1	-0,11%	6,64%
CAC 40	4834,63	+0,02%	4,26%
DJIA	19918,88	-0,12%	14,31%
NASDAQ	5447,42	-0,44%	8,79%
S&P 500	2260,96	-0,19%	10,62%
NIKKEI 225	19427,67	-0,09%	2,07%

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.