

# Dnevni izvještaj financijskih tržišta

**27. prosinac 2016.**

# Pregled deviznog tržišta

Spot rates		
	BID	ASK
EURUSD	1,0448	1,0453
EURCHF	1,0745	1,0750
EURGBP	0,8514	0,8519
EURJPY	122,47	122,51
GBPUSD	1,2269	1,2273
USDJPY	117,23	117,25
GOLD	1143,71	1144,48
BRENT	53,72	53,74

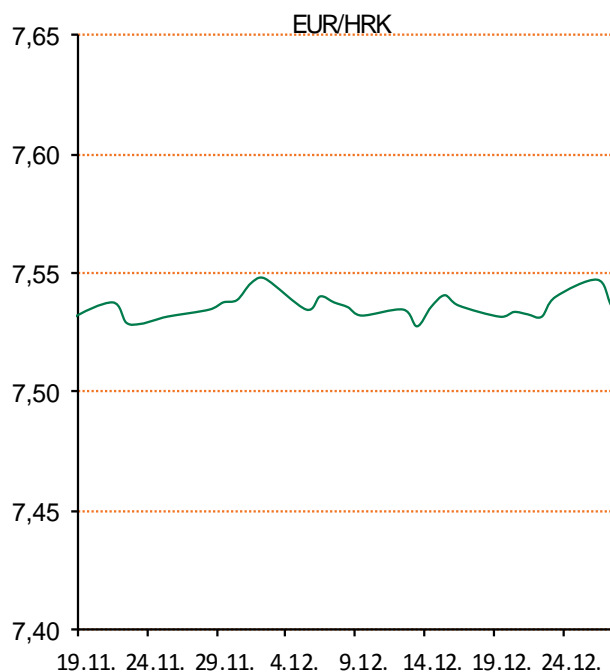
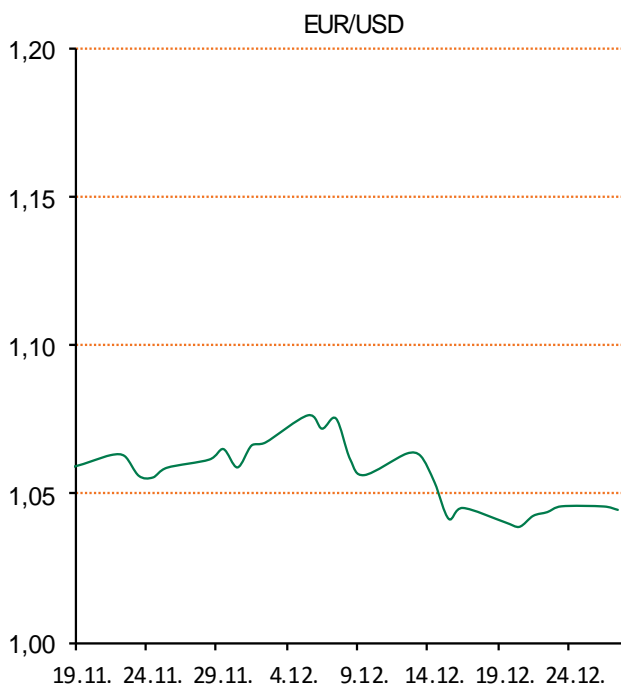
Forward points EUR/HRK		
	BID	ASK
O/N	0,1	1,7
T/N	0,1	1,7
1W	0	14
2W	3	30
1M	20	76
3M	81	248
6M	114	553
12M	300	1165

Interest rate swap ap EUR		
	BID	ASK
1Y	-0,204	-0,184
2Y	-0,151	-0,141
3Y	-0,0925	-0,0725
4Y	-0,007	0,003
5Y	0,1	0,11
7Y	0,3375	0,3575
9Y	0,594	0,604
10Y	0,691	0,701

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,5100	7,5600
USDHRK	7,1845	7,2358
CHFHRK	6,9860	7,0358
GBPHRK	8,8156	8,8795
JPYHRK	6,1301	6,1729
AUDHRK	5,1668	5,2023
CADHRK	5,3100	5,3492
NOKHRK	0,8252	0,8310
DKKHRK	1,0101	1,0169
SEKHRK	0,7795	0,7849
HUFHRK	2,4283	2,4468
PLNHRK	1,7066	1,7197
CZKHRK	0,2778	0,2799

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

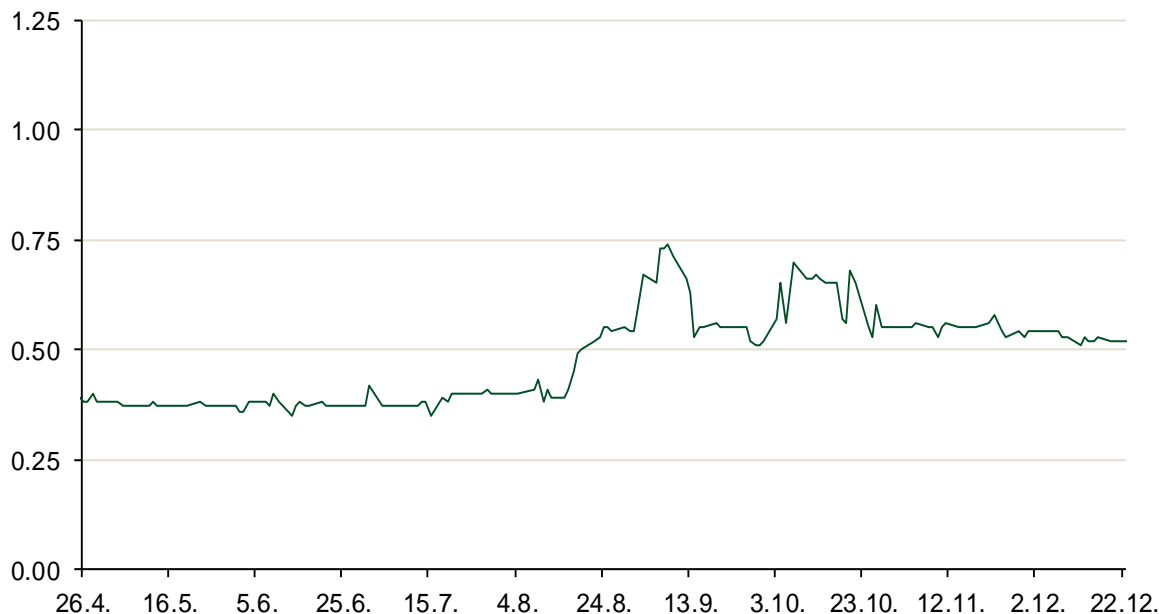
Referentne kamatne stope na dan 26.12.2016					Vrijednost udjela fondova 22.12.2016	
Opis	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	0.69378	-0.797	-	0.52	PBZ Novčani fond	143,4603 HRK
1W	0.71144	-0.872	-0.373	0.53	PBZ Euro novčani	139,3427 EUR
2W			-0.371	0.58	PBZ Dollar	132,5239 USD
1M	0.76111	-0.803	-0.369	0.68	PBZ Short term bond	102,2756 HRK
3M	0.99706	-0.731	-0.317	0.85	PBZ Bond	130,8986 EUR
6M	1.31656	-0.665	-0.217	0.98	PBZ Conservative 10	111,4191 EUR
1Y	1.68956	-0.499	-0.082	1.28	PBZ Flexible 30	101,3415 EUR
					PBZ Global	15,5236 EUR
					PBZ Equity	11,6594 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdavanja	Dat. Dospijeca
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 swapovi			
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.1917	1.2100	-0.6925
2 Y	-0.1620	1.5050	-0.6110
3 Y	-0.1030	1.7440	-0.5240
4 Y	-0.0040	1.9310	-0.4190
5 Y	0.0975	2.0720	-0.3070
6 Y	0.2175	2.1820	-0.1920
7 Y	0.3450	2.2690	-0.0850
8 Y	0.4650	2.3420	0.0120
9 Y	0.5830	2.4010	0.0990
10 Y	0.6840	2.4510	0.1700

PBZ Referentne 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	1.05	
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	115.85	116.55	1.39	1.18	
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	120.00	120.70	2.61	2.49	
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	118.55	119.25	2.98	2.89	
<i>HRK - Kunske</i>							
RHMF-O-172A	4.750%	08.02.2017	100.45	100.65	0.70	-1.06	
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	104.95	105.45	0.76	0.23	
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	106.05	106.55	1.25	0.94	
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	115.25	116.25	1.80	1.48	
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	102.35	103.35	2.20	1.97	
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	111.05	112.05	3.02	2.88	
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	110.40	111.40	3.03	2.91	

## Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	97.85	0.23
Francuska	95.70	0.70
Austrija	102.74	0.46
Italija	94.88	1.82
Španjolska	99.26	1.38
Portugal	93.03	3.76
Češka	104.84	0.48
Grčka	77.04	7.19
Slovenija	137.88	0.85

## Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos		
			Bid	Ask	Bid	Ask	
<i>Republika Hrvatska</i>							
CROATIA USD 2017	6.250%	27.04.2017	101.45	101.95	1.77	0.28	
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	108.45	108.95	0.31	0.01	
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.45	108.95	3.60	3.43	
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	108.55	109.05	4.01	3.87	
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	108.55	109.05	4.15	4.03	
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	107.65	108.15	2.35	2.26	
CROATIA USD 2023	5.5%	04.04.2023.	105.30	105.80	4.52	4.43	
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	108.15	108.65	4.64	4.56	
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	100.65	101.15	2.91	2.84	

## CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	51	132	205
Italija	76	125	161
Spain	28	53	77

## 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	7.86
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	2.46	0.75
HEP USD	5.875%	23.10.2022	106.10	107.10	4.66	4.47

## Bund futures



# Pregled dioničkog tržišta

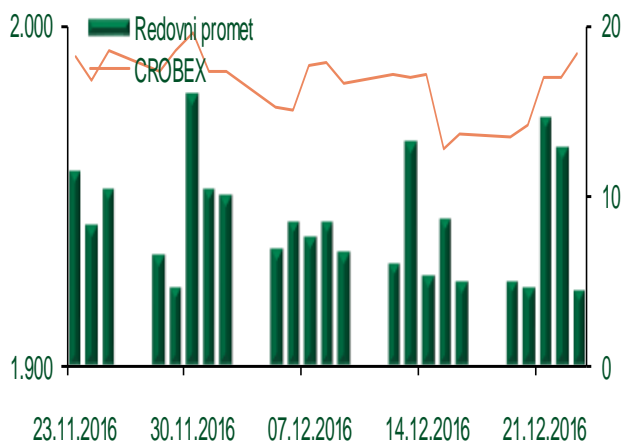
## Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 23.12.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	4.321,65
Redovni promet ('000 HRK)	4.321,65
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	124.003,02
<b>Vrijednost CROBEX indeksa</b>	<b>1.991,43</b>
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,36%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	17,86%
<b>Vrijednost CROBEX10 indeksa</b>	<b>1.160,28</b>
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,20%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	17,29%

Izvor: Zagrebačka burza

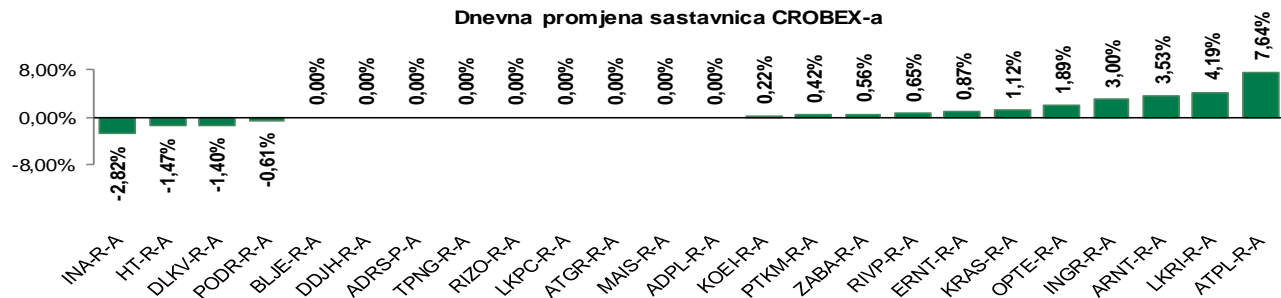
## Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



## Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 23.12.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
ATGR-R-A	Atlantic grupa d.d.	870,00	0,00%	4,45%	716,02	2.900,84
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	174,05	-1,47%	20,53%	377,33	14.252,70
AUHR-R-A	Auto Hrvatska d.d.	872,00	0,00%	93,78%	357,52	577,04
LKRI-R-A	Luka Rijeka d.d.	48,00	4,19%	7,87%	294,40	287,06
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	34,18	0,65%	42,00%	294,06	4.307,62

## Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



## Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 23.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	710,90	-0,24%	10,37%
BELEXline	1.556,88	-0,32%	12,78%
SBI TOP	705,21	0,50%	1,31%
SASX-10	682,99	2,41%	-2,30%
BIRS	560,68	-0,72%	-14,92%
MONEX 20	11.302,76	1,79%	-6,80%
MBI-10	2.163,16	0,00%	18,00%

Izvor: službene stranice burzi regije

## Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 23.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7068,17	+0,06%	13,23%
DAX 30	11449,93	-0,05%	6,58%
CAC 40	4839,68	+0,10%	4,37%
DJIA	19933,81	+0,07%	14,40%
NASDAQ	5462,69	+0,28%	9,09%
S&P 500	2263,79	+0,13%	10,76%
NIKKEI 225	19403,06	+0,03%	1,94%

Izvor: Bloomberg

# Kontakti

## Riznica i ALM

Prodaja rizničnih proizvoda  
[treasurysales@pbz.hr](mailto:treasurysales@pbz.hr)

01 4891 301

Riznica  
[treasury@pbz.hr](mailto: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](mailto: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.