

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

29. prosinac 2016.

Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,0456	1,0460
EURCHF	1,0720	1,0725
EURGBP	0,8530	0,8535
EURJPY	121,66	121,71
GBPUSD	1,2254	1,2259
USDJPY	116,36	116,37
GOLD	1149,01	1149,78
BRENT	55,00	55,02

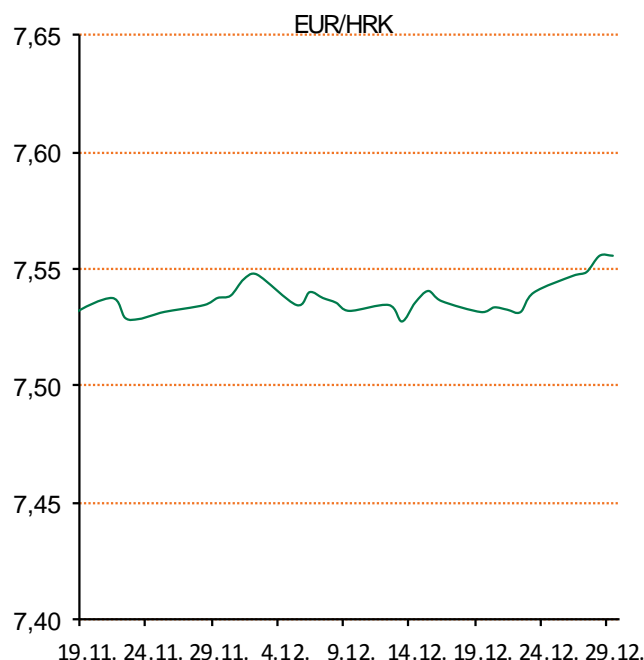
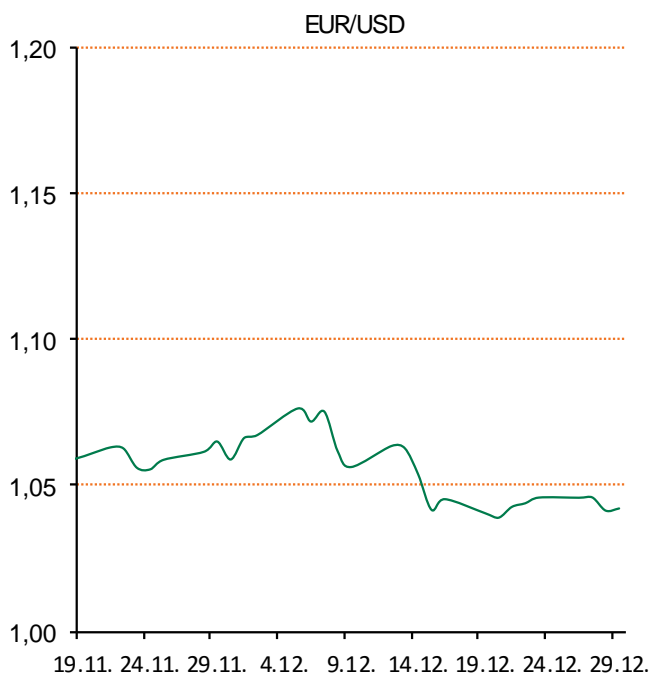
	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	0,3	1,8
T/N	0,3	1,8
1W	1	15
2W	3	30
1M	15	74
3M	82	248
6M	121	587
12M	299	1160

	Interest rate sw ap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,22	-0,18
2Y	-0,16	-0,155
3Y	-0,11	-0,09
4Y	-0,03	-0,01
5Y	0,0745	0,0895
7Y	0,3115	0,3265
9Y	0,5495	0,5645
10Y	0,65	0,67

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,5300	7,5800
USDHRK	7,1989	7,2494
CHFHRK	7,0210	7,0709
GBPHRK	8,8225	8,8863
JPYHRK	6,1868	6,2305
AUDHRK	5,1877	5,2229
CADHRK	5,3238	5,3618
NOKHRK	0,8286	0,8344
DKKHRK	1,0129	1,0197
SEKHRK	0,7852	0,7908
HUFHRK	2,4381	2,4562
PLNHRK	1,7057	1,7182
CZKHRK	0,2784	0,2805

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

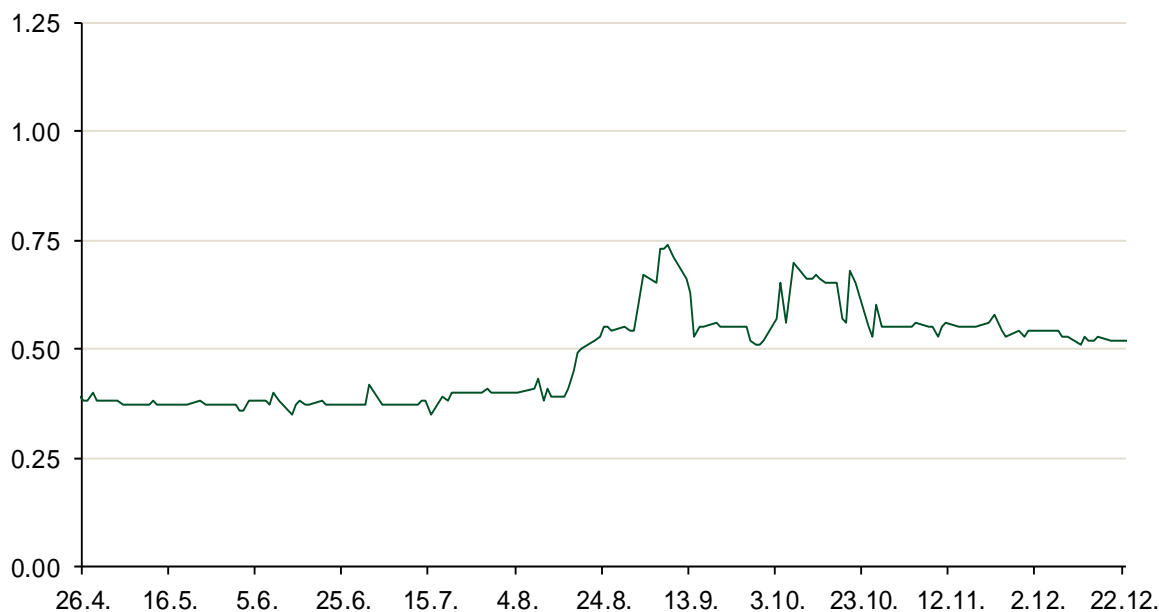
Referentne kamatne stope na dan 28.12.2016					Vrijednost udjela fondova 27.12.2016	
Opis	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	0.69378	-0.797	-	0.52	PBZ Novčani fond	143,4626 HRK
1W	0.71144	-0.872	-0.369	0.53	PBZ Euro novčani	139,3394 EUR
2W			-0.371	0.58	PBZ Dollar	132,5412 USD
1M	0.76111	-0.803	-0.366	0.68	PBZ Short term bond	102,3192 HRK
3M	0.99706	-0.731	-0.319	0.85	PBZ Bond	131,0491 EUR
6M	1.31656	-0.665	-0.221	0.98	PBZ Conservative 10	111,5518 EUR
1Y	1.68956	-0.499	-0.082	1.28	PBZ Flexible 30	101,3699 EUR
					PBZ Global	15,5526 EUR
					PBZ Equity	11,6711 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financijska RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdavanja	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 swapovi			
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.2100	1.2020	-0.6900
2 Y	-0.1700	1.4860	-0.5990
3 Y	-0.1000	1.7130	-0.5190
4 Y	-0.0220	1.8820	-0.4270
5 Y	0.0700	2.0110	-0.3160
6 Y	0.1925	2.1190	-0.2030
7 Y	0.3090	2.2060	-0.0950
8 Y	0.4300	2.2770	0.0080
9 Y	0.5490	2.3370	0.0860
10 Y	0.6490	2.3880	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	1.26	1.03
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	115.85	116.55	1.37	1.17
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	2.88
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-172A	4.750%	08.02.2017	100.45	100.65	0.27	-1.67
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	104.95	105.45	0.69	0.15
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	106.05	106.55	1.22	0.91
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	115.25	116.25	1.78	1.46
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	98.31	0.18
Francuska	96.19	0.65
Austrija	103.31	0.41
Italija	95.05	1.81
Španjolska	99.64	1.34
Portugal	93.06	3.75
Češka	104.92	0.47
Grčka	77.59	7.10
Slovenija	137.99	0.84

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	1.62	0.08
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	108.45	108.95	0.28	-0.03
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.20	108.70	3.68	3.50
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	108.60	109.10	3.99	3.84
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	108.60	109.10	4.13	4.01
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	107.40	107.90	2.40	2.30
CROATIA USD 2023	5.5%	04.04.2023	104.90	105.40	4.59	4.50
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	108.00	108.50	4.66	4.58
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	100.35	100.85	2.95	2.88

CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	57	139	214
Italija	76	125	162
Spain	28	53	77

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	103.60	104.60	7.78	7.42
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	103.20	104.20	8.32	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	2.41	0.69
HEP USD	5.875%	23.10.2022	106.10	107.10	4.66	4.47

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

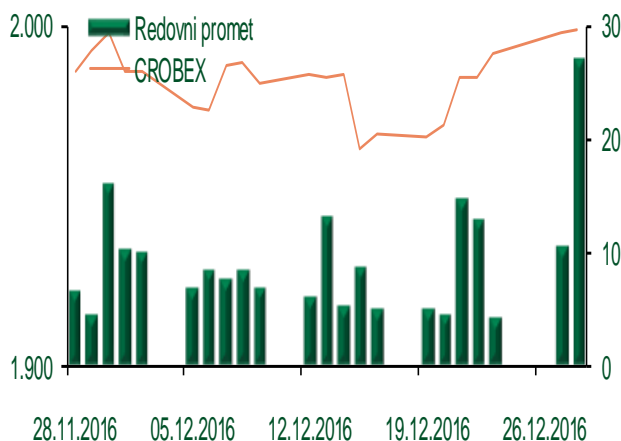
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 28.12.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	27.192,36
Redovni promet ('000 HRK)	27.192,36
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	81.688,63
Vrijednost CROBEX indeksa	1.998,86
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,04%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	18,30%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.165,54
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,01%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	17,82%

Izvor: Zagrebačka burza

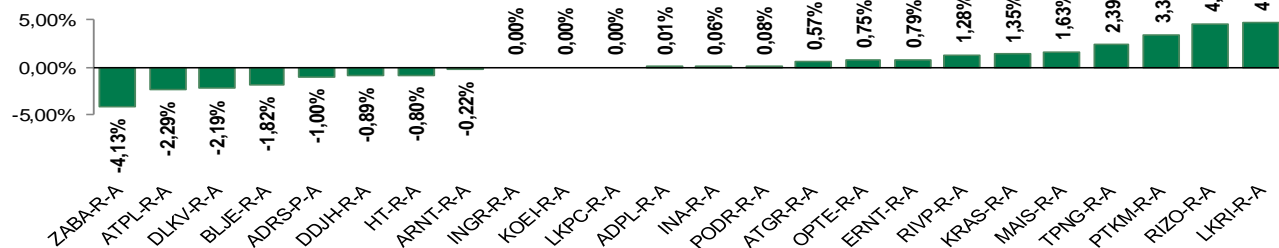
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 28.12.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
INA-R-A	INA - Industrija nafte d.d.	3.202,07	0,06%	8,49%	1.128,18	32.020,70
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	173,60	-0,80%	20,22%	1.000,49	14.215,85
JMNC-R-A	Jamnica d.d.	140.000,00	1,45%	21,85%	974,00	3.097,64
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	34,70	1,28%	44,16%	856,28	4.373,16
AGMM-R-A	Agromedimurje d.d.	350,00	55,52%	74,97%	520,10	14,49

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 28.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	714,60	-0,32%	10,95%
BELEXline	1.563,90	-0,30%	13,29%
SBI TOP	708,21	0,64%	1,74%
SASX-10	677,85	-0,37%	-3,03%
BIRS	555,36	-0,08%	-15,73%
MONEX 20	11.277,27	0,65%	-7,02%
MBI-10	2.148,57	-0,98%	17,20%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 28.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7106,08	+0,54%	13,84%
DAX 30	11474,99	+0,02%	6,81%
CAC 40	4848,01	-0,01%	4,55%
DJIA	19833,68	-0,56%	13,82%
NASDAQ	5438,56	-0,89%	8,61%
S&P 500	2249,92	-0,84%	10,08%
NIKKEI 225	19145,14	-1,32%	0,59%

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.