

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

30. prosinac 2016.

Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,0516	1,0517
EURCHF	1,0745	1,0750
EURGBP	0,8563	0,8568
EURJPY	123,02	123,03
GBPUSD	1,2276	1,2279
USDJPY	116,95	116,98
GOLD	1159,26	1160,03
BRENT	54,78	54,80

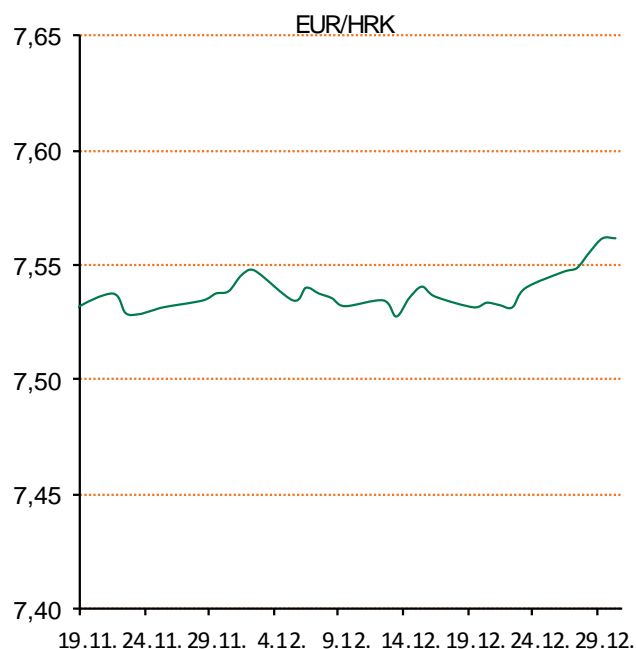
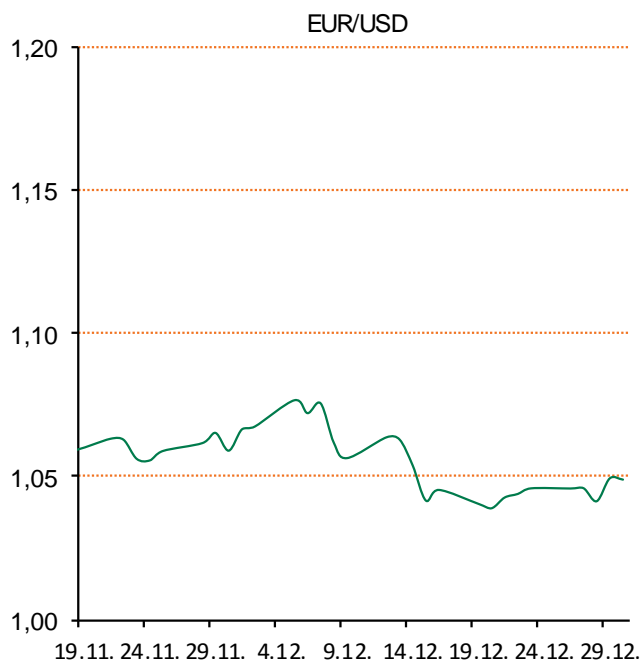
	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	-0,6	5,4
T/N	-8,6	1,7
1W	-2	19
2W	-3	27
1M	-7	61
3M	0	139
6M	120	585
12M	299	1160

	Interest rate swap ap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,218	-0,188
2Y	-0,164	-0,154
3Y	-0,123	-0,073
4Y	-0,023	-0,013
5Y	0,077	0,087
7Y	0,302	0,322
9Y	0,538	0,558
10Y	0,642	0,662

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,5300	7,5800
USDHRK	7,1598	7,2081
CHFHRK	7,0047	7,0544
GBPHRK	8,7885	8,8520
JPYHRK	6,1205	6,1616
AUDHRK	5,1682	5,2060
CADHRK	5,3066	5,3452
NOKHRK	0,8286	0,8344
DKKHRK	1,0129	1,0197
SEKHRK	0,7864	0,7921
HUFHRK	2,4179	2,4357
PLNHRK	1,7039	1,7167
CZKHRK	0,2785	0,2806

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

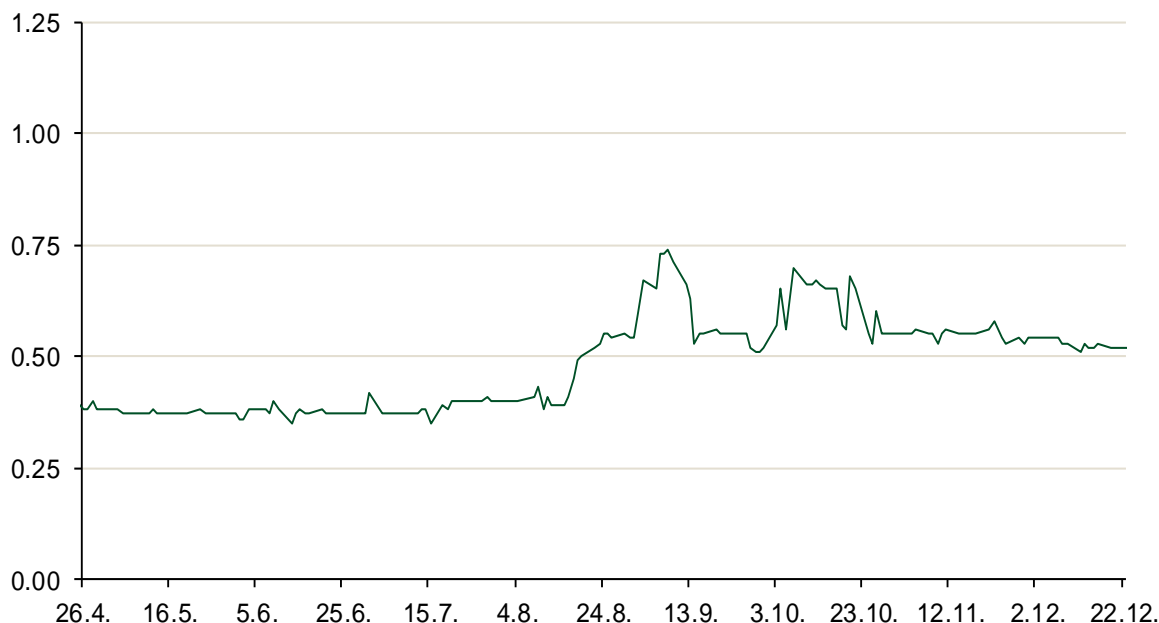
Referentne kamatne stope na dan 29.12.2016					Vrijednost udjela fondova 28.12.2016	
Opis	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	0.68656	-0.815	-	0.51	PBZ Novčani fond	143,4631 HRK
1W	0.71533	-0.833	-0.374	0.53	PBZ Euro novčani	139,3393 EUR
2W			-0.373	0.57	PBZ Dollar	132,5447 USD
1M	0.77	-0.810	-0.368	0.67	PBZ Short term bond	102,3005 HRK
3M	0.99817	-0.733	-0.319	0.83	PBZ Bond	131,0181 EUR
6M	1.31767	-0.665	-0.221	0.96	PBZ Conservative 10	111,5183 EUR
1Y	1.69011	-0.499	-0.081	1.25	PBZ Flexibile 30	101,3013 EUR
					PBZ Global	15,5441 EUR
					PBZ Equity	11,6867 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	-0.2200	1.1910	-0.6875
2 Y	-0.1700	1.4720	-0.6130
3 Y	-0.1020	1.7000	-0.5300
4 Y	-0.0240	1.8690	-0.4290
5 Y	0.0800	1.9990	-0.3190
6 Y	0.1800	2.1060	-0.2090
7 Y	0.3110	2.1920	-0.1030
8 Y	0.4300	2.2630	-0.0140
9 Y	0.5400	2.3230	0.0800
10 Y	0.6411	2.3740	0.1520

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	1.26	1.03
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	115.85	116.55	1.37	1.16
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	120.00	120.70	2.61	2.48
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	0.15	-1.85
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	104.95	105.45	0.68	0.14
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	106.05	106.55	1.22	0.90
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	1.96
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	98.23	0.19
Francuska	96.03	0.67
Austrija	103.25	0.41
Italija	95.03	1.81
Španjolska	99.58	1.35
Portugal	93.08	3.75
Češka	104.88	0.47
Grčka	77.59	7.10
Slovenija	137.82	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	101.30	101.80	2.05	0.49
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	108.45	108.95	0.27	-0.04
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.45	108.95	3.59	3.41
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	108.70	109.20	3.96	3.81
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	108.80	109.30	4.08	3.96
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	107.40	107.90	2.40	2.30
CROATIA USD 2023	5.5%	04.04.2023.	105.50	106.00	4.48	4.39
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	108.50	109.00	4.58	4.50
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	54	141	220
Italija	77	127	164
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	7.85
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	2.40	0.67
HEP USD	5.875%	23.10.2022	106.10	107.10	4.66	4.47

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

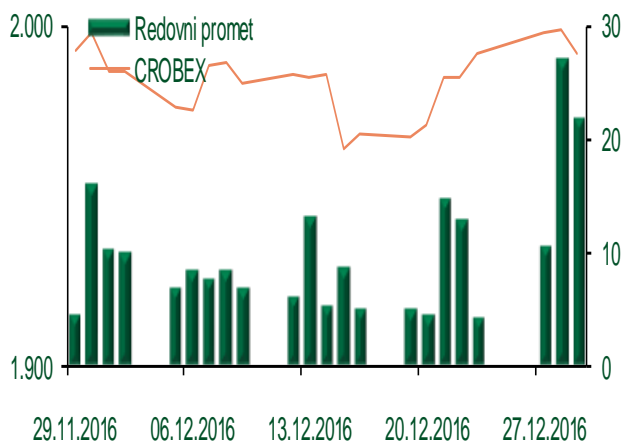
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 29.12.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	27.724,55
Redovni promet ('000 HRK)	21.824,55
Prijavljeni promet ('000 HRK)	5.900,00
OTC promet ('000 HRK)	270.376,89
Vrijednost CROBEX indeksa	1.991,33
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,38%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	17,86%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.155,98
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,82%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	16,85%

Izvor: Zagrebačka burza

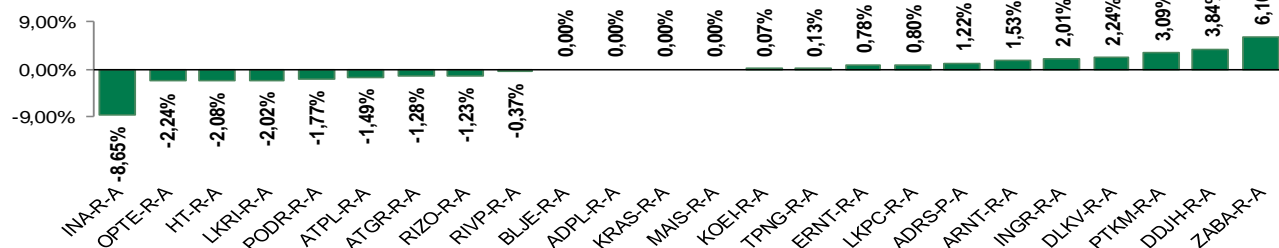
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 29.12.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	34,57	-0,37%	43,62%	2.647,00	4.356,77
ADRS-P-A	Adris Grupa d.d.	457,50	1,22%	25,34%	1.571,79	3.103,73
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	169,99	-2,08%	17,72%	1.500,33	13.920,23
ATGR-R-A	Atlantik grupa d.d.	873,65	-1,28%	4,89%	1.274,00	2.913,01
KOEI-R-A	Končar elektroindustrija d.d.	691,99	0,07%	3,59%	1.251,12	1.779,88

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 29.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	714,72	0,02%	10,96%
BELEXline	1.562,68	-0,08%	13,20%
SBI TOP	711,28	0,43%	2,18%
SASX-10	682,15	0,63%	-2,42%
BIRS	550,26	-0,92%	-16,50%
MONEX 20	11.270,11	-0,06%	-7,07%
MBI-10	2.134,91	-0,64%	16,45%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 29.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7120,26	+0,20%	14,06%
DAX 30	11451,05	-0,21%	6,59%
CAC 40	4838,47	-0,20%	4,34%
DJIA	19819,78	-0,07%	13,74%
NASDAQ	5432,09	-0,12%	8,48%
S&P 500	2249,26	-0,03%	10,05%
NIKKEI 225	19114,37	-0,16%	0,42%

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.