

# Dnevni izvještaj financijskih tržišta

04.siječanj 2016.

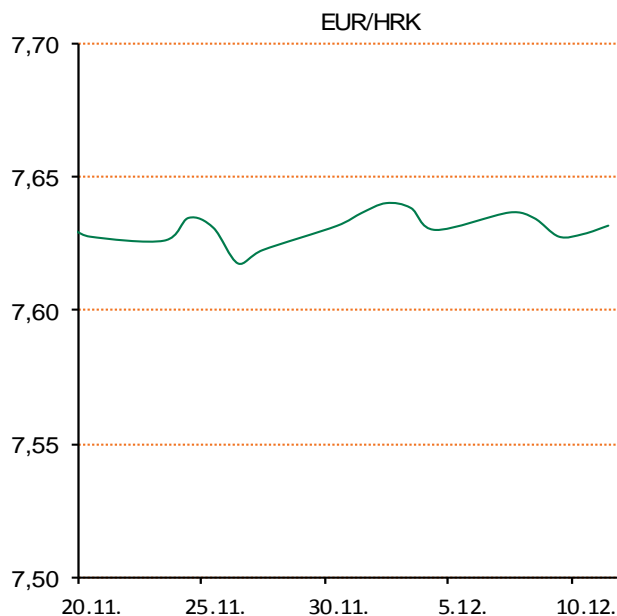
# Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,0929	1,0932
EURCHF	1,0861	1,0863
EURGBP	0,7403	0,7404
EURJPY	129,82	129,85
GBPUSD	1,4762	1,4767
USDJPY	118,78	118,81
GOLD	1070,66	1071,43
BRENT	37,90	37,92

	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	1,3	2,8
T/N	2,5	5,5
1W	9	19
2W	21	42
1M	43	99
3M	126	319
6M	156	859
12M	464	1855

	Interest rate swap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,0671	-0,053
2Y	-0,046	-0,036
3Y	0,0208	0,0708
4Y	0,153	0,173
5Y	0,284	0,304
7Y	0,5639	0,5839
9Y	0,83	0,838
10Y	0,931	0,961

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,6100	7,6600
USDHRK	6,9612	7,0089
CHFHRK	7,0054	7,0528
GBPHRK	10,2782	10,3472
JPYHRK	5,8606	5,9005
AUDHRK	5,0191	5,0541
CADHRK	4,9967	5,0312
NOKHRK	0,7873	0,7928
DKKHRK	1,0198	1,0266
SEKHRK	0,8271	0,8330
HUFHRK	2,4091	2,4277
PLNHRK	1,7727	1,7855
CZKHRK	0,2815	0,2835



# Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamatne stope na dan			03.01.2016	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	0,2745	-0,783	-	0,61	
1W	0,38975	-0,827	-0,249	0,68	
2W			-0,236	0,76	
1M	0,4295	-0,798	-0,205	0,96	
3M	0,6127	-0,756	-0,131	1,17	
6M	0,84615	-0,690	-0,040	1,45	
1Y	1,178	-0,592	0,060	1,85	

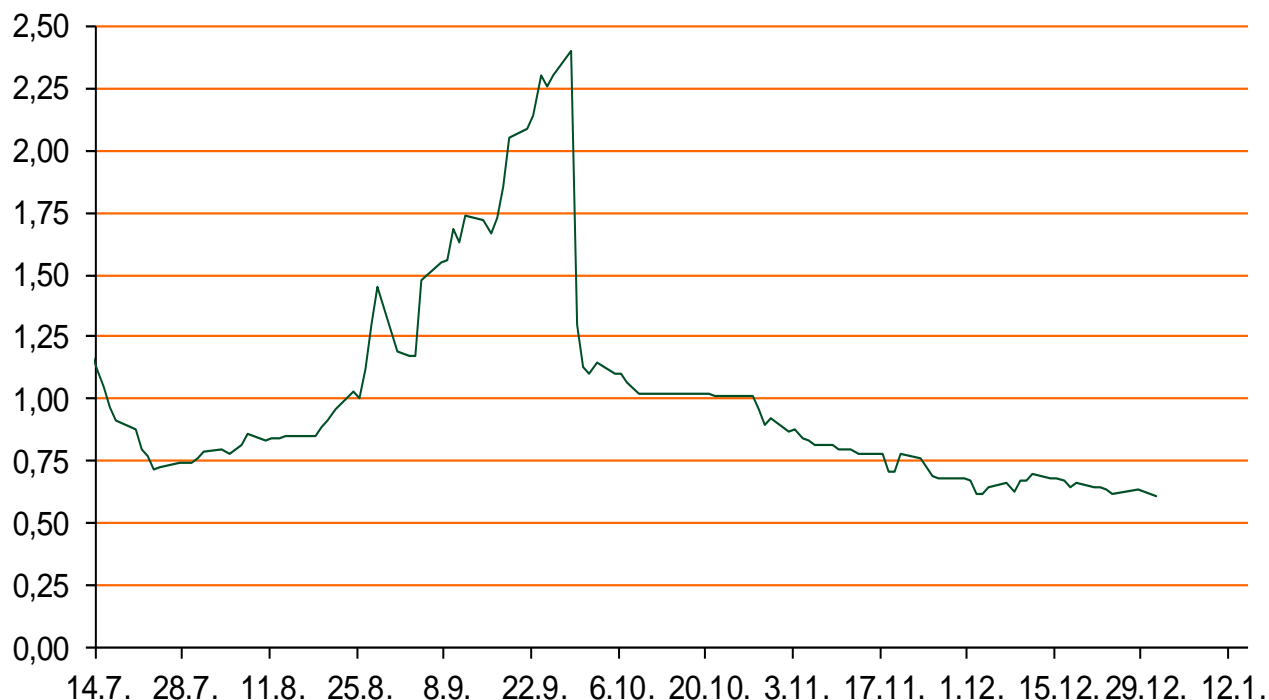
Vrijednost udjela fondova	30.12.2015
Fond	
PBZ Novčani fond	143,0610 HRK
PBZ Euro novčani	139,1042 EUR
PBZ Dollar	131,1291 USD
PBZ Short term bond	99,8733 HRK
PBZ Bond	123,7787 EUR
PBZ Conservative 10	105,0530 EUR
PBZ Flexibile 30	99,7339 EUR
PBZ Global	14,3526 EUR
PBZ Equity	10,2331 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financijska RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospijeća
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	-0,0763	-	-
2 Y	-0,0450	1,1480	-0,6630
3 Y	0,0270	1,3780	-0,5870
4 Y	0,1600	1,5560	-0,4680
5 Y	0,2800	1,6980	-0,3300
6 Y	0,4310	1,8210	-0,1950
7 Y	0,5670	1,9260	-0,0700
8 Y	0,6920	2,0150	0,0420
9 Y	0,8250	2,0920	0,1410
10 Y	0,9200	2,1590	0,2200

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	109,70	110,20	2,73	2,60
RHMF-O-203E	6,500%	05.03.2020	114,65	115,35	2,75	2,58
RHMF-O-227E	6,500%	22.07.2022	116,15	116,85	3,70	3,59
RHMF-O-247E	5,750%	10.07.2024	112,80	113,50	3,96	3,87
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-167A	5,750%	22.07.2016	101,90	102,40	2,19	1,28
RHMF-O-172A	4,750%	08.02.2017	102,55	103,05	2,36	1,90
RHMF-O-17BA	6,250%	25.11.2017	106,60	107,10	2,63	2,37
RHMF-O-187A	5,250%	10.07.2018	105,80	106,80	2,84	2,44
RHMF-O-203A	6,750%	05.03.2020	113,35	114,35	3,29	3,02
RHMF-O-257A	4,500%	09.07.2025	103,20	104,20	4,09	3,96
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	103,97	0,57
Francuska	100,61	0,94
Austrija	103,28	0,85
Italija	104,12	1,56
Španjolska	103,74	1,73
Portugal	103,33	2,49
Češka	104,08	0,60
Grčka	70,24	8,30
Slovenija	132,15	1,68

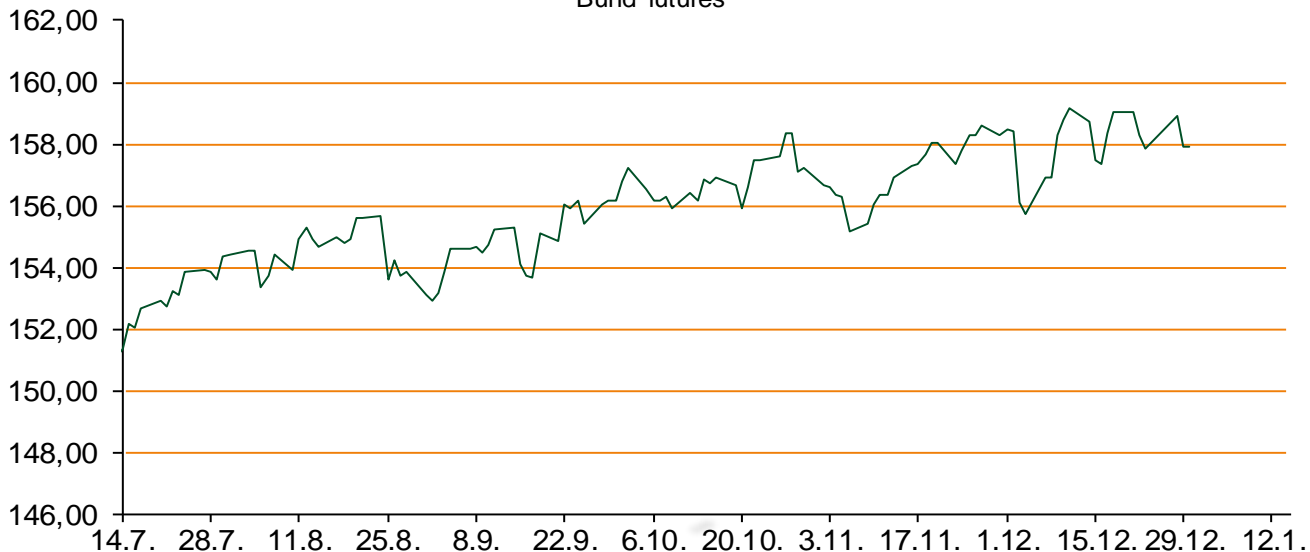
## Eurobonds Rep. Hrvatske i hrvatskih kompanija

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA USD 2017	6,250%	27.04.2017	103,50	104,00	3,47	3,09
CROATIA EUR 2018	5,875%	09.07.2018	108,75	109,25	2,23	2,04
CROATIA USD 2019	6,750%	05.11.2019	107,00	107,50	4,73	4,59
CROATIA USD 2020	6,625%	14.07.2020	107,00	108,00	4,88	4,64
CROATIA USD 2021	6,375%	24.03.2021	106,05	107,05	5,04	4,83
CROATIA EUR 2022	3,875%	30.05.2022	99,80	100,80	3,91	3,73
CROATIA USD 2023	5,5%	04.04.2023	101,25	102,25	5,29	5,12
CROATIA USD 2024	6,000%	26.01.2024	103,90	104,90	5,40	5,25
CROATIA EUR 2025	3,000%	09.03.2025	90,55	91,05	4,27	4,19
<i>Hrvatske kompanije</i>						
AGROKOR 2020	9,125%	10.10.2020	106,50	107,50	7,25	6,97
AGROKOR 2019	9,875%	01.05.2019	106,90	107,90	7,48	7,15
ZG. HOLDING 2017	5,500%	10.07.2017	94,00	95,00	9,94	9,16
HEP USD	6,000%	09.11.2017	105,60	106,60	2,85	2,31
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	244	310
Italija	31	67	96
Spain	28	62	89

## Bund futures



# Pregled dioničkog tržišta

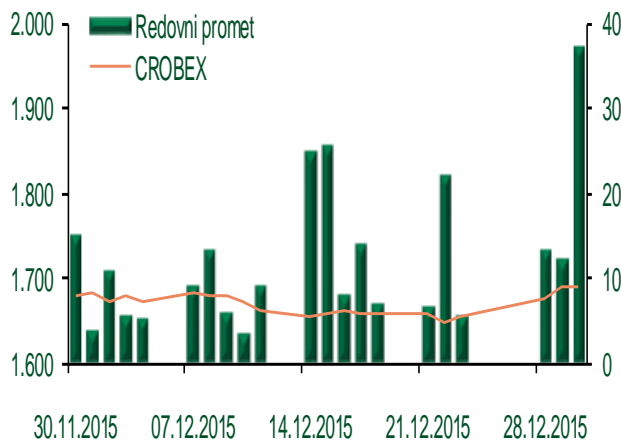
## Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 30.12.2015.

Ukupni promet ('000 HRK)	37.140,36
Redovni promet ('000 HRK)	37.140,36
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	172.816,55
<b>Vrijednost CROBEX indeksa</b>	<b>1.689,63</b>
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,02%
Promjena CROBEX indeksa u 2015.	-3,20%
<b>Vrijednost CROBEX10 indeksa</b>	<b>989,28</b>
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,74%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2015.	-1,77%

Izvor: Zagrebačka burza

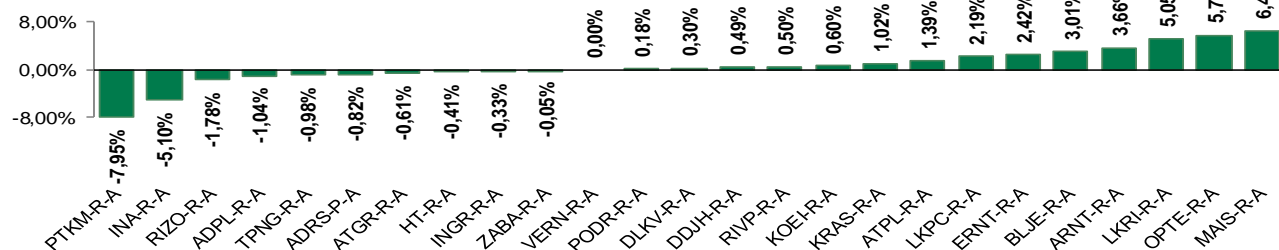
## Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



## Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 30.12.2015.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
ATGR-R-A	Atlantic grupa d.d.	832,90	-0,61%	-11,39%	3.594,45	2.777,14
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	24,07	0,50%	21,14%	3.348,77	3.033,48
ADRS-P-A	Adris Grupa d.d.	365,00	-0,82%	7,35%	2.867,14	2.476,20
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	144,40	-0,41%	-4,05%	1.396,04	11.824,70
JMNC-R-A	Jamnica d.d.	114.895,00	0,79%	30,56%	795,83	2.542,17

## Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



## Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 31.12.2015.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	644,10	2,07%	-3,44%
BELEXline	1.380,42	1,56%	2,65%
SBI TOP	696,15	0,00%	-11,21%
SASX-10	699,04	2,05%	-2,20%
BIRS	658,99	-0,33%	-8,64%
MONEX 20	12.128,07	1,00%	6,80%
MBI-10	1.833,26	0,73%	-0,59%

Izvor: službene stranice burzi regije

## Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 31.12.2015.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	6242,32	-0,51%	-4,93%
DAX 30	10743,01	-1,08%	9,56%
CAC 40	4637,06	-0,86%	8,53%
DJIA	17425,03	-1,02%	-2,23%
NASDAQ	5007,41	-1,15%	5,73%
S&P 500	2043,94	-0,94%	-0,73%
NIKKEI 225	18450,98	-3,06%	5,73%

Izvor: Bloomberg

# Kontakti

Riznica i upravljanje aktivom i pasivom  
[treasury@pbz.hr](mailto: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](mailto: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.