

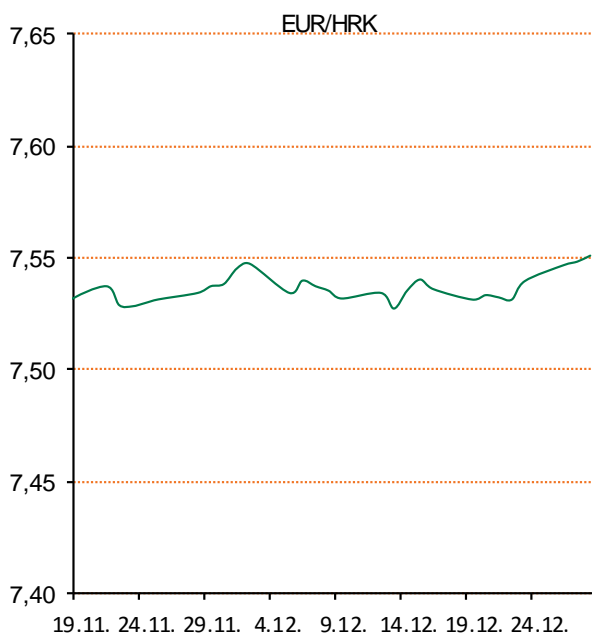
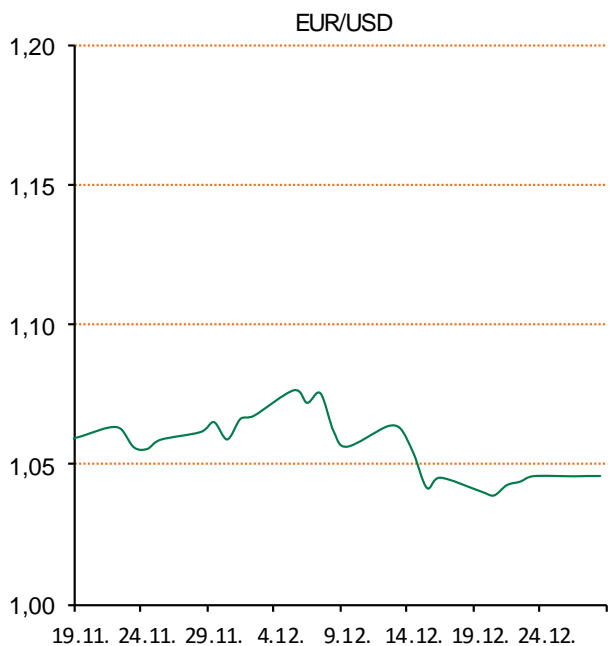
Dnevni izvještaj financijskih tržišta

28. prosinac 2016.

Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,0443	1,0445	O/N	0,3	1,9	1Y	-0,2	-0,19
EURCHF	1,0739	1,0747	T/N	0,3	1,9	2Y	-0,162	-0,157
EURGBP	0,8516	0,8520	1W	1	15	3Y	-0,103	-0,098
EURJPY	122,79	122,84	2W	3	30	4Y	-0,022	-0,018
GBPUSD	1,2257	1,2261	1M	20	74	5Y	0,074	0,084
USDJPY	117,6	117,63	3M	82	249	7Y	0,3255	0,3305
GOLD	1140,45	1141,45	6M	122	590	9Y	0,5705	0,5755
BRENT	54,55	54,57	12M	300	1164	10Y	0,6775	0,6825

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,5100	7,5600
USDHRK	7,1900	7,2393
CHFHRK	6,9880	7,0398
GBPHRK	8,8146	8,8774
JPYHRK	6,1136	6,1569
AUDHRK	5,1761	5,2113
CADHRK	5,2943	5,3333
NOKHRK	0,8254	0,8314
DKKHRK	1,0099	1,0167
SEKHRK	0,7809	0,7862
HUFHRK	2,4295	2,4470
PLNHRK	1,7045	1,7167
CZKHRK	0,2777	0,2799



Pregled novčanog tržišta

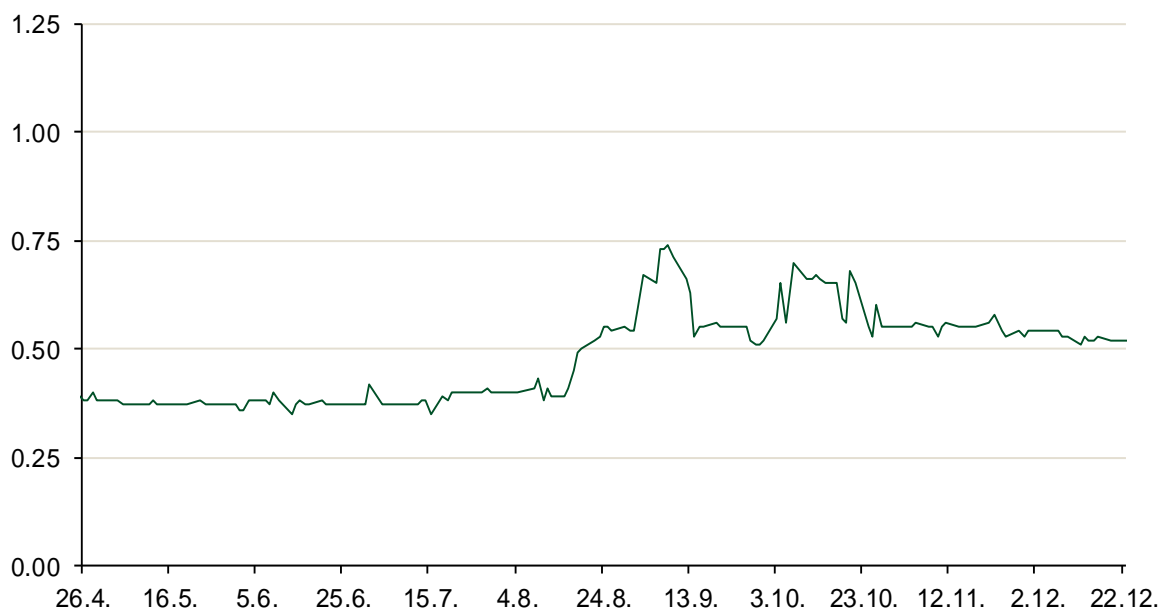
Referentne kamatne stope na dan 27.12.2016					Vrijednost udjela fondova 23.12.2016	
Opis	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	Fond	
O/N	0.69378	-0.797	-	0.52	PBZ Novčani fond	143,4612 HRK
1W	0.71144	-0.872	-0.369	0.53	PBZ Euro novčani	139,3424 EUR
2W			-0.371	0.58	PBZ Dollar	132,5290 USD
1M	0.76111	-0.803	-0.369	0.68	PBZ Short term bond	102,2714 HRK
3M	0.99706	-0.731	-0.318	0.85	PBZ Bond	130,9113 EUR
6M	1.31656	-0.665	-0.220	0.98	PBZ Conservative 10	111,4394 EUR
1Y	1.68956	-0.499	-0.081	1.28	PBZ Flexible 30	101,3715 EUR
					PBZ Global	15,5239 EUR
					PBZ Equity	11,6531 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija 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	1.2100	-0.6875
2 Y	-0.1638	1.5170	-0.6525
3 Y	-0.1063	1.7600	-0.5562
4 Y	-0.0240	1.9430	-0.4240
5 Y	0.0700	2.0790	-0.3130
6 Y	0.1915	2.1870	-0.2000
7 Y	0.3185	2.2720	-0.0930
8 Y	0.4300	2.3420	0.0020
9 Y	0.5540	2.4000	0.0900
10 Y	0.6725	2.4490	0.1670

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	1.27	1.04
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	0.60	-1.20
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	104.95	105.45	0.74	0.21
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	106.05	106.55	1.25	0.93
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	115.25	116.25	1.79	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	111.60	112.60	2.95	2.81
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	110.90	111.90	2.98	2.86

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	98.18	0.19
Francuska	96.12	0.66
Austrija	103.10	0.43
Italija	94.76	1.84
Španjolska	99.33	1.37
Portugal	92.87	3.78
Češka	104.84	0.48
Grčka	76.71	7.25
Slovenija	137.72	0.86

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA USD 2017	6.250%	27.04.2017	101.40	101.90	1.88	0.38
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	108.50	109.00	0.27	-0.03
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.45	108.95	3.60	3.42
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	108.55	109.05	4.01	3.86
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	108.55	109.05	4.15	4.03
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	107.30	107.80	2.42	2.32
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	4.63	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	63	148	228
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	2.45	0.73
HEP USD	5.875%	23.10.2022	106.10	107.10	4.66	4.47

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

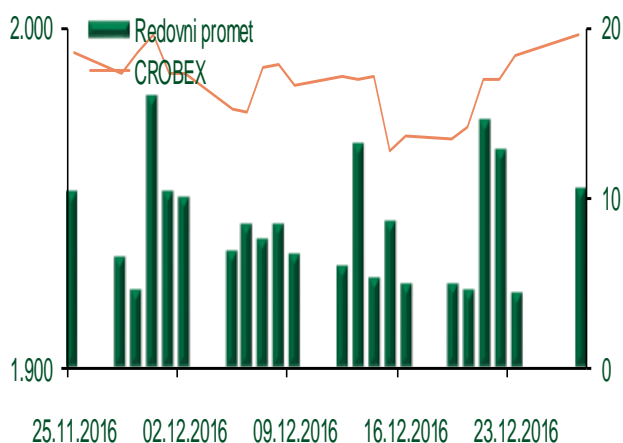
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 27.12.2016.

Ukupni promet ('000 HRK)	10.468,74
Redovni promet ('000 HRK)	10.468,74
Prijavljeni promet ('000 HRK)	0,00
OTC promet ('000 HRK)	35.521,65
Vrijednost CROBEX indeksa	1.998,11
Dnevna promjena CROBEX indeksa	0,34%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	18,26%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.165,40
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	0,44%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	17,80%

Izvor: Zagrebačka burza

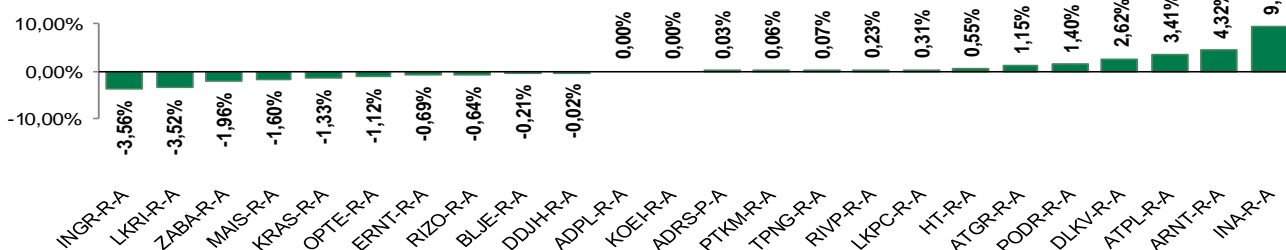
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 27.12.2016.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	175,00	0,55%	21,19%	1.065,17	14.330,49
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	34,26	0,23%	42,33%	747,03	4.317,70
AUHR-R-A	Auto Hrvatska d.d.	887,00	1,72%	97,11%	653,81	586,97
PODR-R-A	Podravka d.d.	381,99	1,40%	14,36%	302,67	2.070,39
ADRS-P-A	Adris Grupa d.d.	456,56	0,03%	25,08%	260,75	3.097,35

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 27.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	716,90	0,84%	11,30%
BELEXline	1.568,57	0,75%	13,63%
SBI TOP	703,69	-0,22%	1,09%
SASX-10	680,35	0,00%	-2,67%
BIRS	555,78	-0,87%	-15,66%
MONEX 20	11.204,18	-0,87%	-7,62%
MBI-10	2.169,93	0,00%	18,36%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 27.12.2016.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7068,17	+0,06%	13,23%
DAX 30	11472,24	+0,19%	6,79%
CAC 40	4848,28	+0,18%	4,56%
DJIA	19945,04	+0,06%	14,46%
NASDAQ	5487,44	+0,45%	9,59%
S&P 500	2268,88	+0,22%	11,01%
NIKKEI 225	19401,72	-0,01%	1,93%

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.