

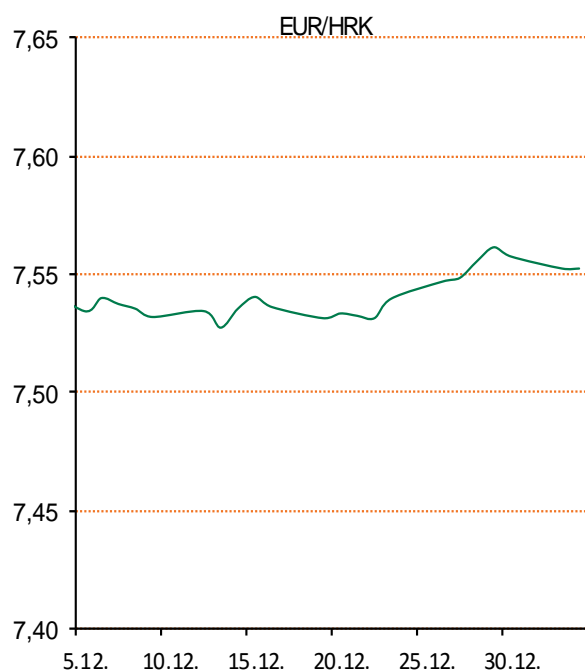
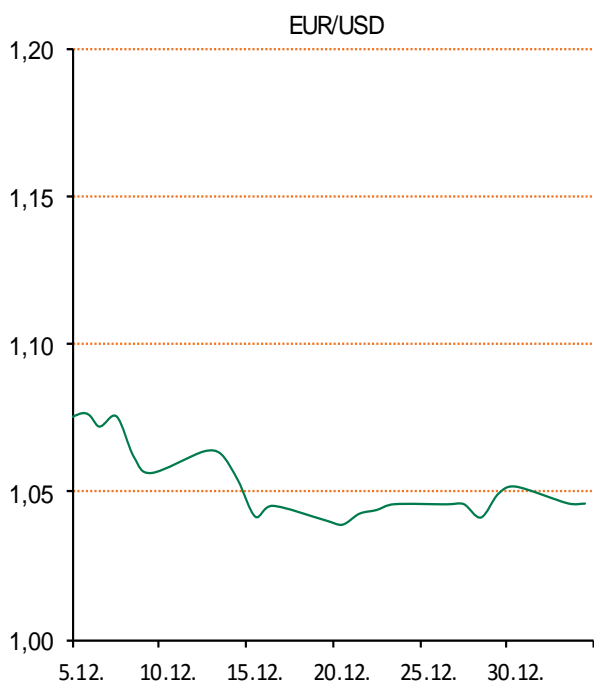
Dnevni izvještaj financijskih tržišta

03. siječanj 2017.

Pregled deviznog tržišta

Spot rates			Forward points EUR/HRK			Interest rate swap EUR		
	BID	ASK		BID	ASK		BID	ASK
EURUSD	1,0430	1,0431	O/N	-0,4	1,7	1Y	-0,21	-0,2
EURCHF	1,0695	1,0696	T/N	-0,4	1,7	2Y	-0,18	-0,16
EURGBP	0,8493	0,8494	1W	-2	12	3Y	-0,13	-0,1
EURJPY	123,05	123,09	2W	-2	27	4Y	-0,039	-0,031
GBPUSD	1,2281	1,2282	1M	-6	59	5Y	0,064	0,074
USDJPY	117,98	117,99	3M	9	210	7Y	0,296	0,306
GOLD	1150,70	1152,20	6M	19	456	9Y	0,53	0,56
BRENT	54,89	54,91	12M	191	1074	10Y	0,629	0,669

Cross-rates PBZ		
	BID	ASK
EURHRK	7,5300	7,5800
USDHRK	7,2189	7,2675
CHFHRK	7,0400	7,0874
GBPHRK	8,8651	8,9250
JPYHRK	6,1175	6,1601
AUDHRK	5,2064	5,2420
CADHRK	5,3770	5,4135
NOKHRK	0,8342	0,8399
DKKHRK	1,0128	1,0196
SEKHRK	0,7896	0,7950
HUFHRK	2,4315	2,4486
PLNHRK	1,7095	1,7230
CZKHRK	0,2784	0,2806



Pregled novčanog tržišta

Opis	Referentne kamatne stope na dan			02.01.2017	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	0.69211	-0.797	-	0.49	
1W	0.72333	-0.810	-0.371	0.51	
2W			-0.374	0.54	
1M	0.77167	-0.799	-0.368	0.64	
3M	0.99789	-0.729	-0.318	0.81	
6M	1.31767	-0.663	-0.220	0.93	
1Y	1.68567	-0.499	-0.083	1.19	

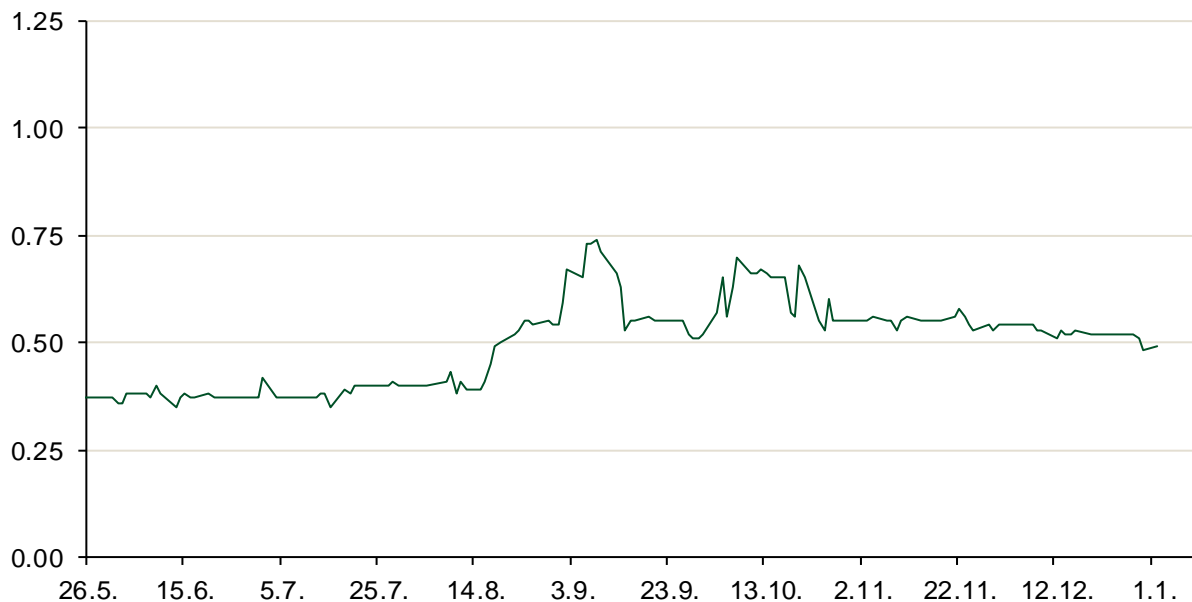
Vrijednost udjela fondova		30.12.2016
Fond		
PBZ Novčani fond		143,4623 HRK
PBZ Euro novčani		139,3384 EUR
PBZ Dollar		132,5562 USD
PBZ Short term bond		102,3929 HRK
PBZ Bond		131,0796 EUR
PBZ Conservative 10		111,7274 EUR
PBZ Flexible 30		101,2324 EUR
PBZ Global		15,4949 EUR
PBZ Equity		11,7071 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financija RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mo)	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	1.2000	-0.6900
2 Y	-0.1820	1.4790	-0.6070
3 Y	-0.1400	1.7040	-0.5290
4 Y	-0.0540	1.8730	-0.4250
5 Y	0.0500	2.0010	-0.3220
6 Y	0.1687	2.1040	-0.2080
7 Y	0.2900	2.1880	-0.1040
8 Y	0.4100	2.2570	-0.0060
9 Y	0.5300	2.3130	0.0790
10 Y	0.6400	2.3630	0.1480

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	111.30	112.00	1.38	1.15
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	115.50	116.20	1.47	1.26
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	120.10	120.80	2.59	2.46
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	118.60	119.30	2.97	2.88
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-172A	4.750%	08.02.2017	100.40	100.60	0.41	-1.70
RHMF-O-17BA	6.250%	25.11.2017	104.80	105.30	0.81	0.26
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	106.00	106.50	1.24	0.92
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	115.10	116.10	1.81	1.50
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	102.30	103.30	2.21	1.98
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	111.10	112.10	3.01	2.87
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	98.18	0.19
Francuska	96.07	0.66
Austrija	103.12	0.42
Italija	95.62	1.74
Španjolska	99.65	1.34
Portugal	93.28	3.72
Češka	104.85	0.48
Grčka	77.41	7.13
Slovenija	137.89	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	101.35	101.85	1.82	0.23
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	108.50	109.00	0.22	-0.09
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	108.50	109.00	3.56	3.39
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	107.50	108.00	2.38	2.28
CROATIA USD 2023	5.5%	04.04.2023	105.55	106.05	4.47	4.38
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	108.30	108.80	4.61	4.53
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	100.80	101.30	2.89	2.82

CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	64	144	223
Italija	83	129	165
Spain	27	53	79

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	2.38	0.64
HEP USD	5.875%	23.10.2022	106.10	107.10	4.66	4.47

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

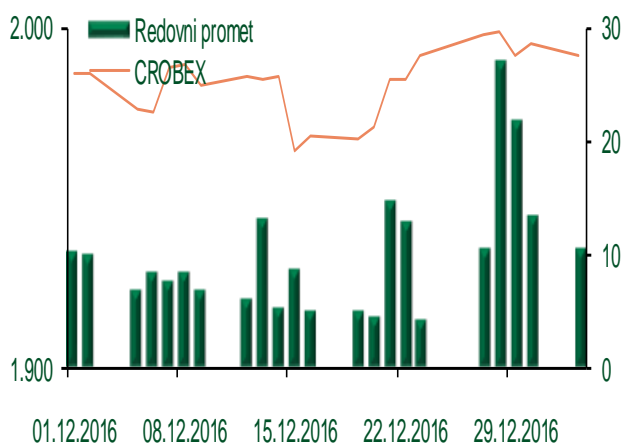
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 02.01.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	14.018,75
Redovni promet ('000 HRK)	10.437,26
Prijavljeni promet ('000 HRK)	3.581,49
OTC promet ('000 HRK)	157.251,57
Vrijednost CROBEX indeksa	1.991,97
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,14%
Promjena CROBEX indeksa u 2016.	-0,14%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.157,88
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,03%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2016.	-0,03%

Izvor: Zagrebačka burza

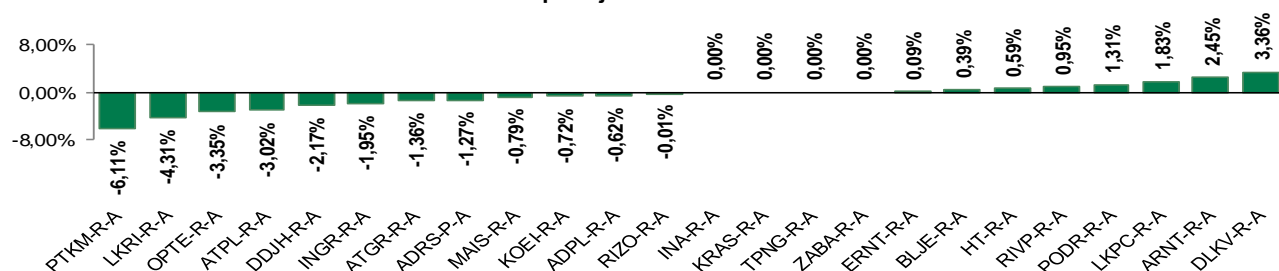
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 02.01.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
AUHR-R-A	Auto Hrvatska d.d.	980,00	3,38%	3,38%	2.848,06	648,51
HT-R-A	Hrvatski Telekom d.d.	170,00	0,59%	0,59%	2.464,72	13.921,05
RVP-R-A	VALAMAR RIVIERA dioničko društvo za tu	35,19	0,95%	0,95%	1.029,87	4.434,91
ADRS-P-A	Adris Grupa d.d.	454,04	-1,27%	-1,27%	986,84	3.080,25
ATPL-R-A	Atlantska plovidba d.d.	274,01	-3,02%	-3,02%	632,50	373,27

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 02.01.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	717,37	0,37%	0,00%
BELEXline	1.569,43	0,43%	0,00%
SBI TOP	717,59	0,89%	0,00%
SASX-10	690,48	1,22%	0,00%
BIRS	546,67	-0,65%	0,00%
MONEX 20	11.510,59	2,13%	0,00%
MBI-10	2.134,91	0,00%	0,00%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 02.01.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7142,83	+0,32%	0,00%
DAX 30	11598,33	+1,02%	1,02%
CAC 40	4882,38	+0,41%	0,41%
DJIA	19762,6	-0,29%	0,00%
NASDAQ	5383,12	-0,90%	0,00%
S&P 500	2238,83	-0,46%	0,00%
NIKKEI 225	19114,37	-0,16%	0,00%

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.