

Dnevni izvještaj financijskih tržišta

22. prosinac 2017.

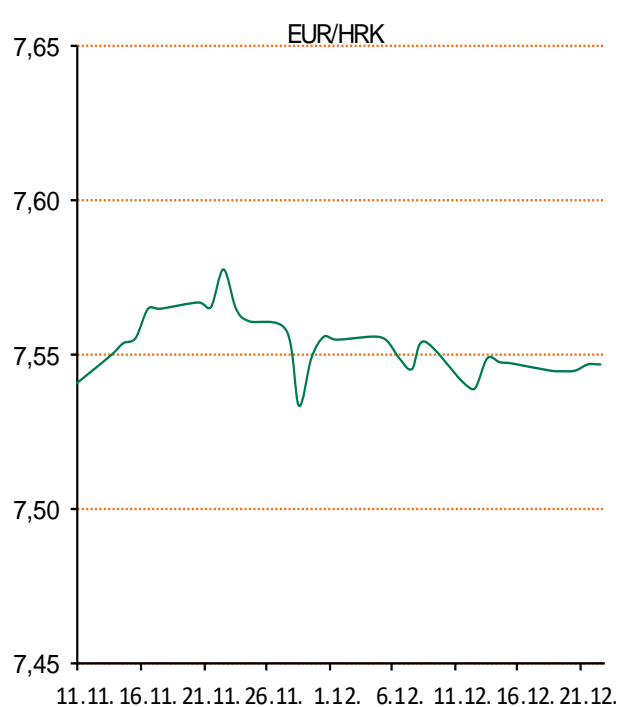
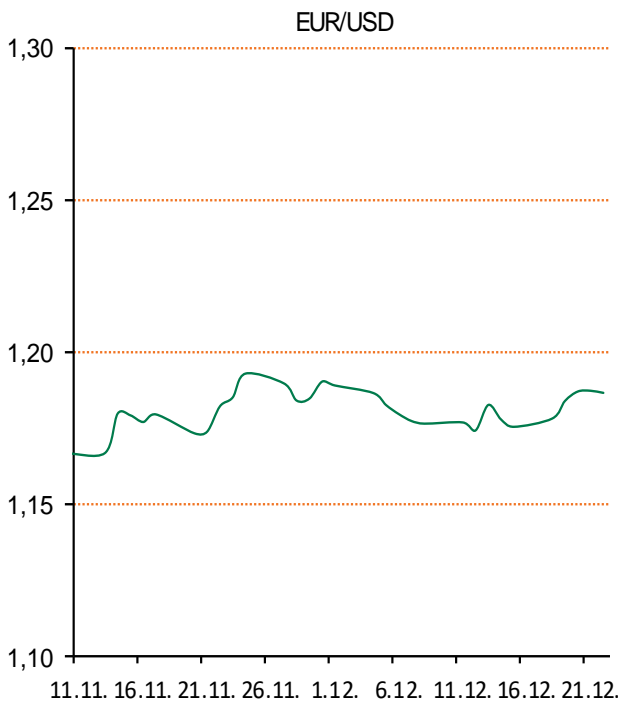
Pregled deviznog tržišta

	Spot rates	
	BID	ASK
EURUSD	1,1846	1,1849
EURCHF	1,1728	1,1729
EURGBP	0,8857	0,8860
EURJPY	134,34	134,35
GBPUSD	1,3375	1,3378
USDJPY	113,41	113,42
GOLD	1267,61	1268,61
BRENT	64,98	65,00

	Forward points EUR/HRK	
	BID	ASK
O/N	0,9	1,3
T/N	4,8	6,5
1W	5	10
2W	11	20
1M	23	44
3M	28	123
6M	38	287
12M	76	651

	Interest rate swap EUR	
	BID	ASK
1Y	-0,28	-0,23
2Y	-0,161	-0,155
3Y	-0,023	0,018
4Y	0,139	0,169
5Y	0,285	0,315
7Y	0,5425	0,5625
9Y	0,7724	0,7824
10Y	0,8583	0,8983

	Cross-rates PBZ	
	BID	ASK
EURHRK	7,5200	7,5700
USDHRK	6,3465	6,3903
CHFHRK	6,4115	6,4546
GBPHRK	8,4876	8,5469
JPYHRK	5,5973	5,6350
AUDHRK	4,8962	4,9297
CADHRK	4,9857	5,0196
NOKHRK	0,7579	0,7633
DKKHRK	1,0101	1,0169
SEKHRK	0,7560	0,7612
HUFHRK	2,4088	2,4268
PLNHRK	1,7936	1,8061
CZKHRK	0,2925	0,2946



Pregled novčanog tržišta

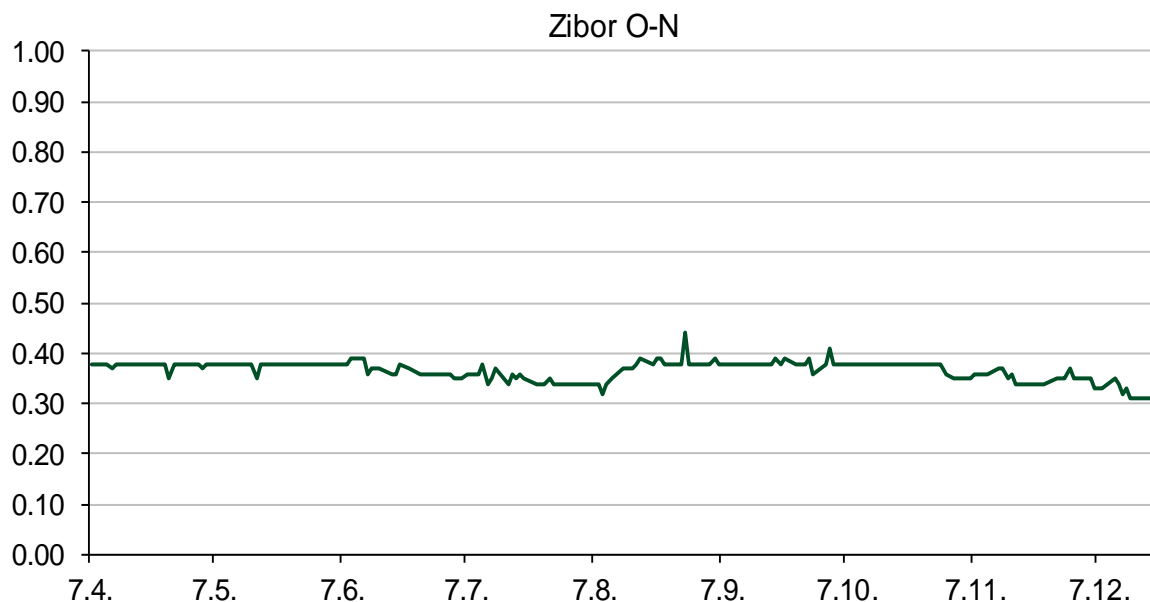
Opis	Referentne kamatne stope na dan			21.12.2017	
	Libor USD	Libor CHF	Euribor	Zibor	
O/N	1.43438	-0.786	-	0.31	
1W	1.45806	-0.805	-0.376	0.37	
2W			-0.371	0.40	
1M	1.53488	-0.826	-0.369	0.50	
3M	1.65793	-0.756	-0.329	0.55	
6M	1.81413	-0.650	-0.271	0.61	
1Y	2.08366	-0.531	-0.186	0.72	

Vrijednost udjela fondova		20.12.2017
Fond		
PBZ Novčani fond		143,5121 HRK
PBZ Euro novčani		128,7458 EUR
PBZ Dollar		133,7241 USD
PBZ Short term bond		104,4042 HRK
PBZ Bond		136,1975 EUR
PBZ Conservative 10		116,9411 EUR
PBZ International Multi Asset		100,0521 EUR
PBZ Flexibile 30		104,6386 EUR
PBZ Global		15,7506 EUR
PBZ Equity		11,4951 EUR

Trezorski zapisi (Rezultati posljednje aukcije Min. Financijska RH)					
Ročnost	Valuta	Prinos	Izdano (Mio)	Dat. Izdanja	Dat. Dospjeća
91	HRK	0.20	50	05.01.2017	06.04.2017
182	HRK	0.25	20	24.08.2017	22.02.2018
364	HRK	0.25	1,300.00	23.11.2017	22.11.2018
364	EUR/VK	0.01	11.1	26.10.2017	25.10.2018
455	EUR	0.10	1500	09.11.2017	07.02.2019

Kamatni swapovi			
	EUR BID	USD BID	CHF BID
1 Y	-0.2793	1.9070	-0.6575
2 Y	-0.1600	2.0880	-0.4970
3 Y	-0.0204	2.1860	-0.3917
4 Y	0.1430	2.2470	-0.2550
5 Y	0.2890	2.2930	-0.1480
6 Y	0.4210	2.3340	-0.0530
7 Y	0.5440	2.3720	0.0360
8 Y	0.6600	2.4070	0.1190
9 Y	0.7700	2.4390	0.1980
10 Y	0.8571	2.4690	0.2720

PBZ Referentne kamate						
HRK	O/N	1W	1M	3M	6M	
Bid	0.00	0.00	0.00	0.05	0.10	
Ask	0.30	0.30	0.50	0.55	0.60	
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	



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	109.40	110.10	0.47	0.12
RHMF-O-203E	6.500%	05.03.2020	113.36	114.06	0.37	0.08
RHMF-O-227E	6.500%	22.07.2022	122.60	123.30	1.38	1.24
RHMF-O-247E	5.750%	10.07.2024	123.50	124.20	1.91	1.81
<i>HRK - Kunske</i>						
RHMF-O-187A	5.250%	10.07.2018	102.70	103.00	0.25	-0.29
RHMF-O-203A	6.750%	05.03.2020	113.35	114.35	0.61	0.18
RHMF-O-217A	2.750%	08.07.2021	105.65	106.65	1.12	0.84
RHMF-O-222A	2.250%	07.02.2022	104.05	104.55	1.24	1.12
RHMF-O-23BA	1.750%	27.11.2023	101.40	101.90	1.50	1.41
RHMF-O-257A	4.500%	09.07.2025	116.15	117.15	2.17	2.02
RHMF-O-26CA	4.250%	14.12.2026	115.20	116.20	2.36	2.24
RHMF-O-28CA	2.875%	07.02.2028	102.70	103.20	2.57	2.51
RHMF-O-32CA	3.250%	07.07.2032	102.25	103.25	3.06	2.97

Kotacije europskih državnih obveznica dospjeća 10 godina

Izdavatelj	Cijena	Prinos
Njemačka	100.78	0.42
Francuska	100.08	0.74
Austrija	99.23	0.59
Italija	101.09	1.93
Španjolska	99.35	1.52
Portugal	119.87	1.78
Češka	89.72	1.46
Grčka	97.18	4.10
Slovenija	103.89	0.81

Eurobonds Rep. Hrvatske

Naziv	Kupon	Dospijeće	Cijena		Prinos	
			Bid	Ask	Bid	Ask
<i>Republika Hrvatska</i>						
CROATIA EUR 2018	5.875%	09.07.2018	103.20	103.40	-0.11	-0.46
CROATIA USD 2019	6.750%	05.11.2019	107.45	107.95	2.62	2.35
CROATIA USD 2020	6.625%	14.07.2020	109.00	109.50	2.94	2.74
CROATIA USD 2021	6.375%	24.03.2021	110.05	110.55	3.09	2.94
CROATIA EUR 2022	3.875%	30.05.2022	112.00	112.50	1.08	0.97
CROATIA USD 2023	5.500%	04.04.2023	110.25	110.75	3.36	3.26
CROATIA USD 2024	6.000%	26.01.2024	114.00	114.50	3.43	3.35
CROATIA EUR 2025	3.000%	11.03.2025	107.80	108.30	1.83	1.76
CROATIA EUR 2027	3.000%	20.03.2027	107.20	107.70	2.13	2.07
CROATIA EUR 2030	2.750%	07.01.2030	100.80	101.30	2.67	2.62

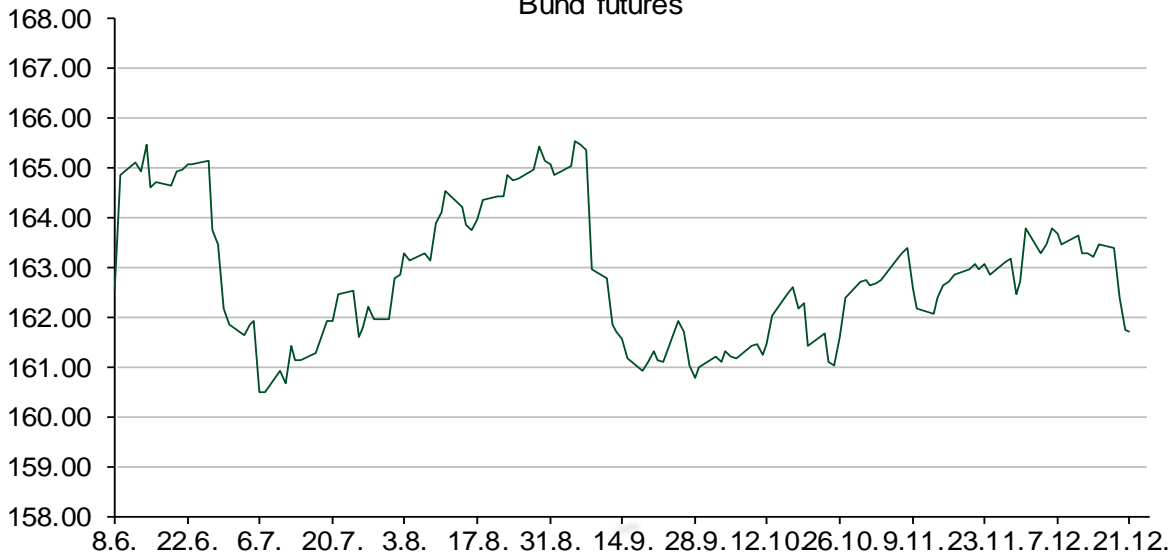
CDS Pregled

Izdavatelj	1 god	3 god	5 god
Hrvatska	17	52	,99
Italija	30	83	116
Spain	16	35	53

Hrvatske korporativne obveznice

AGROKOR 2020	9.125%	10.10.2020	22.60	23.60	110.29	106.57
AGROKOR 2019	9.875%	01.05.2019	24.00	25.00	166.53	160.64
ZG. HOLDING 2023 HRK	3.875%	15.07.2023	105.00	107.00	2.88	2.51
HEP USD	5.875%	23.10.2022	111.25	112.25	3.33	3.12

Bund futures



Pregled dioničkog tržišta

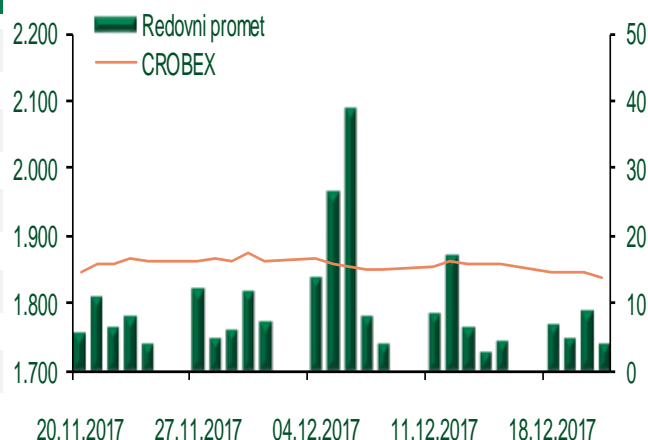
Dnevni pregled trgovanja na ZSE

Podaci za 21.12.2017.

Ukupni promet ('000 HRK)	6.761,74
Redovni promet ('000 HRK)	4.241,74
Prijavljeni promet ('000 HRK)	2.520,00
OTC promet ('000 HRK)	111.889,99
Vrijednost CROBEX indeksa	1.839,23
Dnevna promjena CROBEX indeksa	-0,34%
Promjena CROBEX indeksa u 2017.	-7,80%
Vrijednost CROBEX10 indeksa	1.071,25
Dnevna promjena CROBEX10 indeksa	-0,52%
Promjena CROBEX10 indeksa u 2017.	-7,51%

Izvor: Zagrebačka burza

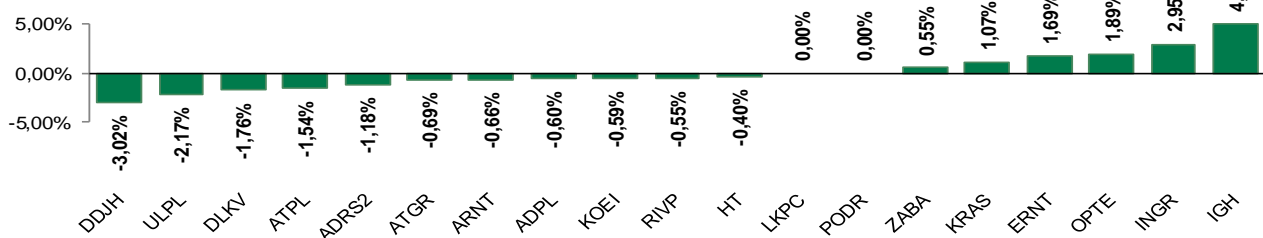
Kretanje vrijednosti CROBEX-a i redovnog prometa



Top 5 najlikvidnijih dionica na Zagrebačkoj burzi

Oznaka	Naziv društva	Zadnja cijena (HRK) na 21.12.2017.	Promjena cijene	Promjena u tekućoj godini	Promet ('000 HRK)	Tržišna kapitalizacija (mil. HRK)
RVP	Valamar Riviera d.d.	43,34	-0,55%	24,33%	744,20	5.462,03
KOEI	Končar - elektroindustrija d.d.	701,82	-0,59%	1,71%	608,88	1.805,16
ADRS2	Adris Grupa d.d.	420,00	-1,18%	-8,68%	547,72	2.849,32
HT	Hrvatski Telekom d.d.	164,61	-0,40%	-2,60%	522,57	13.479,67
ERNT	Ericsson Nikola Tesla d.d.	1.200,00	1,69%	3,09%	156,76	1.597,98

Dnevna promjena sastavnica CROBEX-a



Pregled stanja na burzama u regiji

Indeks	Vrijednost indeksa na 21.12.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
BELEX15	748,40	-0,49%	4,33%
BELEXline	1.635,18	-0,58%	4,19%
SBI TOP	789,44	-0,18%	10,01%
SASX-10	579,01	0,00%	-16,14%
BIRS	564,56	-0,10%	3,27%
MONEX 20	9.917,48	0,30%	-13,84%
MBI-10	2.499,56	0,00%	17,08%

Izvor: službene stranice burzi regije

Pregled stanja na burzama u svijetu

Indeks	Vrijednost indeksa na 21.12.2017.	Dnevna promjena indeksa	Promjena indeksa u tekućoj godini
FTSE 100	7603,98	+1,05%	6,46%
DAX 30	13109,74	+0,31%	14,19%
CAC 40	5385,97	+0,62%	10,77%
DJIA	24782,29	+0,23%	25,40%
NASDAQ	6965,36	+0,06%	29,39%
S&P 500	2684,57	+0,20%	19,91%
NIKKEI 225	22902,76	+0,16%	19,82%

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.