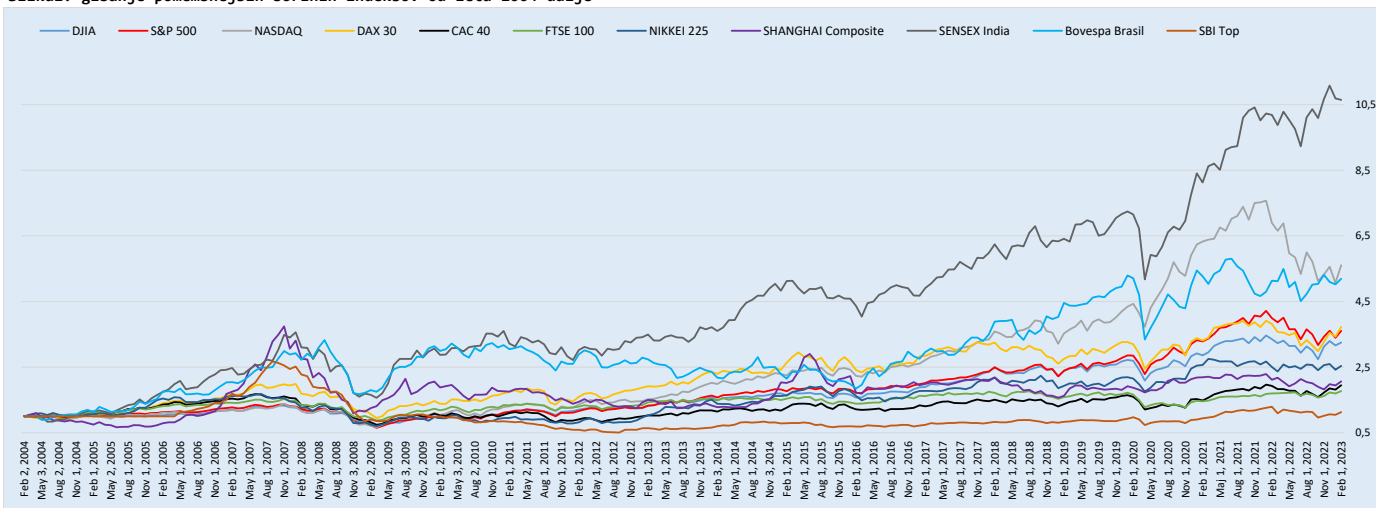


Slika1: gibanje pomembnejših borznih indeksov od leta 2004 dalje



Slika2: donosi različnih kategorij v zadnjem mesecu



Tabela1: donosi izbranih borznih indeksov

indeks	zadnji mesec	zadnjih 12 mesecev	zadnjih 36 mesecev
DJIA	2,83%	-2,98%	20,65%
S&P 500	6,18%	-9,72%	26,40%
NASDAQ	10,68%	-18,65%	26,59%
DAX	8,65%	-2,22%	16,53%
CAC 40	7,40%	0,99%	21,98%
FTSE 100	4,29%	4,12%	6,67%
NIKKEI 225	4,80%	1,28%	17,85%
SHANGHAI Composite	6,33%	-2,28%	10,36%
Sensex India	-0,42%	4,50%	48,85%
Bovespa Brazil	3,37%	1,11%	-0,29%
SBI TOP	7,89%	-12,56%	16,19%

Tabela2: cene izbranih surovin

naziv	enota	cena v USD	sprememba v zadnjem mesecu
nafta WTI	sodček (cca 159L)	79,09	-1,76%
naravni plin	milijon BTU	2,75	-37,92%
zlato	unča (31,1gram)	1.944,60	7,00%
srebro	unča (31,1gram)	23,81	-1,45%
baker	funt (0,45 kg)	4,21	9,35%
platina	unča(31,1 gram)	1.021,60	-7,82%
koruza	bushel (cca 25kg)	6,76	-0,55%
pšenica	bushel (cca 27kg)	7,59	-4,23%
soja	bushel (cca 27kg)	15,36	0,75%
sladkor	funt (0,45kg)	0,22	8,58%
bombaž	funt (0,45kg)	0,86	1,47%

Tabela3: obrestne mere izbranih centralnih bank

banka	trenutna obr. mera %	predhodna obr. mera %	zadnja sprememba
Bank of Canada	4,50	4,25	25.01.2023
Bank of England	3,50	3,00	15.12.2022
Bank of Japan	-0,10	0,10	29.01.2016
European Central Bank	2,50	2,00	15.12.2022
US Federal Reserve	4,50	4,00	14.12.2022
Swiss national Bank	1,00	0,50	15.12.2022
Central Bank of Russia	7,50	8,00	16.09.2022
People's Bank of China	3,65	3,70	22.08.2022
Norges Bank	2,75	2,50	15.12.2022
Banco Central do Brasil	13,75	13,25	03.08.2022

Tabela4: izbrana tečajna razmerja Banke Slovenije

država	valuta	tečaj	sprememba EUR v zadnjem mesecu
ZDA	EUR/USD	1,0833	1,57%
Švica	EUR/CHF	1,0032	1,88%
Japonska	EUR/JPN	141,2700	0,43%
Velika Britanija	EUR/GBP	0,8870	0,01%
Rusija	EUR/RUB	117,2010	0,00%
Norveška	EUR/NOK	10,9083	3,75%
Indija	EUR/INR	88,6360	0,53%
Brazilijska	EUR/BRL	5,5373	-1,80%
Kitajska	EUR/CNY	7,3198	-0,52%
Mehika	EUR/MXN	20,3961	-2,21%

Tabela5: letni donosi izbranih državnih obveznic

država	dospelost	letni donos v %	valuta
ZDA	10-letna	3,488	USD
Švica	10-letna	1,254	CHF
Japonska	10-letna	0,482	JPN
Velika Britanija	10-letna	3,358	GBP
Nemčija	10-letna	2,258	EUR
Francija	10-letna	2,720	EUR
Italija	10-letna	4,231	EUR
Španija	10-letna	3,303	EUR
Slovenija	10-letna	3,425	EUR
Brazilijska	10-letna	13,032	BRL

Tabela6: Razlika v donosu med nemško in izbranimi obveznicami

država	dospelost	donos Nemčija v %	spread v bazičnih točkah
ZDA	10-letna	2,2575	123
Švica	10-letna	2,2575	-100
Japonska	10-letna	2,2575	-178
Velika Britanija	10-letna	2,2575	110
Nemčija	10-letna	2,2575	0
Francija	10-letna	2,2575	46
Italija	10-letna	2,2575	197
Španija	10-letna	2,2575	105
Slovenija	10-letna	2,2575	117
Brazilijska	10-letna	2,2575	1077

*Opomba: podatki veljajo na zadnji dan v mesecu iz naslova

Slika7: Delniški donos po panogah v zadnjem mesecu (panoge: S&P Dow Jones Indices)



Tabela8: Korelacije gibanja izbranih borznih indeksov v zadnjih 12 mesecih

Indeks:	DJIA	S&P 500	NASDAQ	DAX 30	CAC 40	FTSE 100	NIKKEI 225	SHANGHAI Composite	SENSEX India	Bovespa Brasil	SBI Top
DJIA	1,00										
S&P 500	0,93	1,00									
NASDAQ	0,80	0,96	1,00								
DAX 30	0,87	0,87	0,78	1,00							
CAC 40	0,91	0,92	0,85	0,97	1,00						
FTSE 100	0,80	0,84	0,77	0,90	0,89	1,00					
NIKKEI 225	0,80	0,86	0,82	0,70	0,72	0,63	1,00				
SHANGHAI Composite	0,01	0,12	0,20	0,11	0,07	0,25	-0,07	1,00			
SENSEX India	0,79	0,81	0,75	0,66	0,75	0,63	0,76	-0,30	1,00		
Bovespa Brasil	0,49	0,60	0,59	0,44	0,43	0,31	0,61	-0,30	0,60	1,00	
SBI Top	0,68	0,69	0,63	0,65	0,66	0,59	0,83	0,05	0,57	0,32	1,00

Tabela9: Korelacije gibanja cen izbranih surovin v zadnjih 12 mesecih

Surovina:	nafta WTI	naravni plin	zlato	srebro	baker	platina	koruza	pšenica	soja	sladkor	bombaž
nafta WTI	1,00										
naravni plin	0,39	1,00									
zlato	0,26	-0,47	1,00								
srebro	-0,01	-0,66	0,83	1,00							
baker	0,39	-0,35	0,89	0,83	1,00						
platina	-0,28	-0,65	0,51	0,85	0,53	1,00					
koruza	0,37	0,07	0,42	0,40	0,66	0,18	1,00				
pšenica	0,77	0,30	0,22	0,13	0,52	-0,14	0,77	1,00			
soja	0,56	-0,17	0,76	0,69	0,89	0,50	0,71	0,63	1,00		
sladkor	-0,33	-0,62	0,51	0,55	0,36	0,57	0,13	-0,24	0,22	1,00	
bombaž	0,82	0,31	0,54	0,23	0,65	-0,16	0,66	0,80	0,69	-0,15	1,00

Tabela10: Analiza mesečnih donosov borznih indeksov (od 1.maja 2006 do danes)

Indeks:	DJIA	S&P 500	NASDAQ	DAX 30	CAC 40	FTSE 100	NIKKEI 225	SHANGH. Comp.	SENSEX India	Bovespa Brasil	SBI Top
mediana donosa	0,83%	1,24%	1,45%	0,79%	0,48%	0,78%	0,29%	0,67%	0,93%	0,68%	0,27%
standardni odklon	4,35%	4,51%	5,32%	5,36%	4,99%	3,89%	5,48%	7,67%	6,14%	6,53%	5,47%
95. centil	7,19%	7,41%	9,56%	8,71%	7,14%	6,40%	8,98%	13,93%	9,51%	10,79%	8,88%
najslabši mesec	-14,06%	-16,94%	-17,73%	-19,19%	-17,04%	-14,67%	-23,83%	-24,63%	-23,89%	-28,99%	-19,17%
najboljši mesec	13,95%	12,68%	15,45%	16,76%	20,12%	12,35%	15,04%	27,45%	28,26%	16,97%	17,01%
razpon min - max	28,01%	29,63%	33,18%	35,95%	37,16%	27,02%	38,87%	52,08%	52,15%	45,96%	36,18%
negativni prispevek razpoi	50,20%	57,19%	53,44%	53,38%	45,86%	54,29%	61,30%	47,30%	45,81%	63,08%	52,98%
kumulativni donos	205,20%	220,97%	431,67%	165,74%	43,65%	35,78%	76,80%	100,14%	482,92%	210,51%	-1,33%
povprečni letni donos	6,65%	6,95%	9,97%	5,82%	2,15%	1,82%	3,39%	4,13%	10,52%	6,75%	-0,08%

OPOMBE k Tabeli 10:

- mediana donosa = preračunana na mesečni ravni za obdobje od 1. maja 2006 do danes
- standardni odklon = preračunan na mesečni ravni za obdobje od 1. maja 2006 do danes
- 95. centil = preračunan na mesečni ravni za obdobje od 1. maja 2006 do danes (pomeni, da je bil 95% vseh mesecev v obdobjumesečni donos nižji od prikazanega)
- najslabši mesec = donos meseca z najbolj negativnim donosom v obdobju od 1. maja 2006 do danes
- najboljši mesec = donos meseca z najbolj pozitivnim donosom v obdobju od 1. maja 2006 do danes
- razpon min - max = razlika med najbolj pozitivnim in najbolj negativnim mesečnim donosom izražena v odstotnih točkah
- negativni prispevek razpona = delež, ki ga ja k celotnem razponu prispeval negativni mesec
- kumulativni donos = skupni donos obdobja od 1. maja 2006 do danes
- povprečni letni donos = povprečni LETNI donos v obdobju od 1. maja 2006 do danes

Vse prikazane vrednosti so zgolj informativne narave in ne predstavljajo ponudbe za nakup ali prodajo finančnih instrumentov!