

Osnovne informacije o Fondu

Naziv Fonda: Erste Plavi obvezni mirovinski fond kategorije B
Mirovinsko društvo: ERSTE društvo s ograničenom odgovornošću za upravljanje obveznim i dobrovoljnim mirovinskim fondovima
Adresa: Ivana Lučića 2a, 10000 Zagreb
Banka skrbnik: OTP banka d.d., Domovinskog rata 61, Split

OIB mirovinskog društva: 49659289650
Temeljni kapital mirovinskog društva: 82.354.600,00 kuna
OIB Fonda: 37688683890
Datum osnivanja Fonda: 05.11.2001.
Datum početka rada Fonda: 30.04.2002. (Fond kategorije B: 21.08.2014.)

Tko može biti član Fonda?

Svi članovi kojima je ostalo 5 ili više godina do pune starosne mirovine.

Strategija ulaganja i investicijski cilj Fonda

Ciljana struktura portfelja fonda je ulaganje pretežito u dužničke vrijednosne papire, vrijednosne papire s višom razinom prinosa u odnosu na rizik vrijednosnog papira te u vlasničke vrijednosne papire dionice. Također će se koristiti i drugi financijski instrumenti s ciljem postizanja takve strukture ulaganja. Primjenjujući aktivnu strategiju ulaganja ovisno o tržišnim uvjetima koristit će se mogućnost povećanja, odnosno smanjenja izloženosti pojedinoj vrsti vrijednosnih papira sukladno zakonskim limitima. Aktivnim upravljanjem primjenjivat će se i strategije ulaganja koje imaju cilj ostvarivanja viših prinosa uz zadržavanje slične razine rizika. Sigurnost, razboritost i oprez ulaganja ostvarivat će se ulaganjem u vrijednosne papire izdavatelja s odgovarajućim kreditnim rejtingom, raznolikošću instrumenta ulaganja i izdavatelja vrijednosnih papira, pridajući važnost sigurnosti nad prinosom, pri čemu će se upravo zbog sigurnosti naglasiti državni prenosivi vrijednosni papiri u odnosu na korporativne prenosive vrijednosne papire. Na kvartalnim sastancima Investicijskog odbora donose se odluke o kvartalnoj strategiji ulaganja. Na tjednim sastancima Investicijskog odbora donose se odluke o taktici ulaganja i pojedinačnim ulaganjima.

Osnovna načela i ograničenje ulaganja

Imovina mirovinskog fonda može se ulagati u skladu s odredbama Zakona radi povećanja vrijednosti imovine mirovinskog fonda, uz uvažavanje načela sigurnosti, razboritosti i opreza, te smanjenja rizika raspršenošću ulaganja. Ulaganja će se vršiti isključivo u krajnju korist članova mirovinskog fonda i to na takav način koji je u najboljem interesu članova uzimajući u obzir poznate činjenice i okolnosti.

Podaci o prinosu Fonda

Nominalni prinos fonda predstavlja postotnu razliku između vrijednosti obračunske jedinice na prvi i zadnji dan razdoblja u kojem se prinos računa.
Rezultati poslovanja mirovinskog fonda ostvareni u proteklim razdobljima ne predstavljaju indiciju i nemaju nikakav utjecaj na buduće rezultate poslovanja mirovinskog fonda.

Prinos za tekuću godinu	-3,38%
Prinos za prethodnih godinu dana	-2,50%
Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda	5,57%

Prinos za tekuću godinu računa se od 31.12.2019. - 31.10.2020.

Prinos za prethodnih godinu dana računa se od 31.10.2019 - 31.10.2020.

Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda računa se od 30.04.2002. - 31.10.2020.

NAV/VOJ

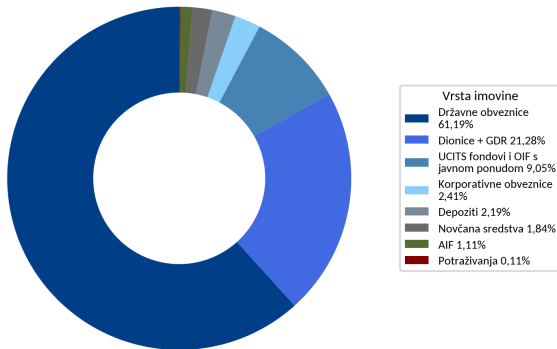
Neto vrijednost imovine na izvještajni datum u HRK:	15.275.052.485,70
Vrijednost obračunske jedinice na izvještajni datum:	272,6879

10 najvećih pozicija ulaganja

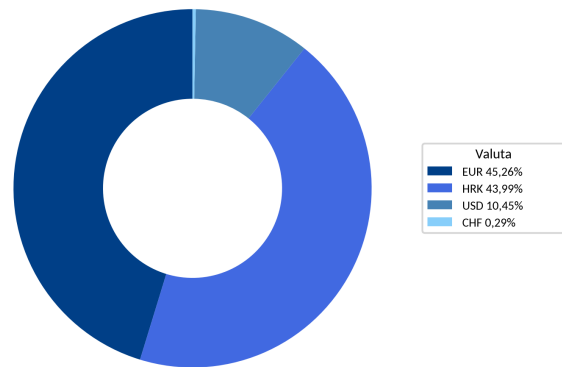
Financijski instrument	Udio u NaV-u
H275E (HRRHMFO275E8), MINISTARSTVO FINACIJA	9,21%
H26CA (HRRHMFO26CA5), MINISTARSTVO FINACIJA	6,16%
H34BA (HRRHMFO34BA1), MINISTARSTVO FINACIJA	5,48%
H227E (HRRHMFO227E9), MINISTARSTVO FINACIJA	5,35%
CROATI 2 3/4 01/27/30 (XS1713475306), RH	5,25%
H282A (HRRHMFO282A2), MINISTARSTVO FINACIJA	3,89%
CROATI 3 03/11/25 (XS1117298916), RH	3,70%
H257A (HRRHMFO257A4), MINISTARSTVO FINACIJA	3,56%
H403E (HRRHMFO403E6), MINISTARSTVO FINACIJA	3,14%
CROATI 3 03/20/27 (XS1428088626), RH	2,63%

Struktura imovine fonda

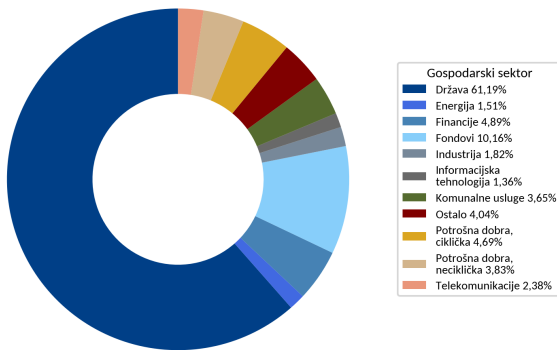
Vrsta imovine



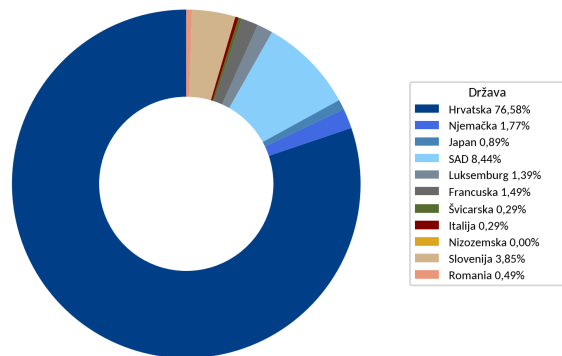
Valutna izloženost



Sektorska izloženost



Geografska izloženost



Struktura imovine prema vrsti prenosivih vrijednosnih papira

Vrsta vrijednosnog papira	Udio u NaV-u
Prenosivi dužnički vrijednosni papiri i instrumenti tržišta novca čiji je izdavatelj RH, druga država članica ili država članica OECD-a	61,19%
Prenosivi dužnički vrijednosni papiri i instrumenti tržišta novca uvrštenih na uređeno tržište, čiji izdavatelj ima sjedište u RH, drugoj državi ili državi članici OECD-a	2,41%
Prenosivi vlasnički vrijednosni papiri uvrštenih na uređeno tržište, čiji izdavatelj dioničko društvo sa sjedištem u RH, drugoj državi ili državi članici OECD-a	21,73%

Udio u neto vrijednosti imovine veći od 10%*

Izdavatelj	Vrijednost svih vrijednosnih papira izdavatelja u mirovinskom fondu	Udio u neto imovini mirovinskog fonda	% prinosa u odnosu na ukupan trošak stjecanja
Ministarstvo financija Republike Hrvatske	9.033.315.591,07	59,14%	14,29%

*Vrijednosni papiri iz članka 125. stavka 1. točaka 1. i 2. izdani od strane jednog izdavatelja, a koji zbirno čine više od 10% neto vrijednosti imovine mirovinskog fonda

Udio u izdanju veći od 10%**

Naziv izdavatelja	Oznaka vrijednosnog papira	Udio u izdavanju	Vrijednost	Tehnika procjene / tržišna cijena	% prinosa u odnosu na ukupan trošak stjecanja	Udio u mirovinskom fondu
PROFESSIO ENERGIA D.D.	HRDLPRRA0007	50,00%	303,6535	Procjena Društva	87,95%	0,66%
JADRAN D.D.	HRJDRNRB0002	30,76%	13,6000	Tržišna cijena	-21,24%	0,76%
Končar-Elektroindustrija d.d.	HRKOEIRA0009	15,46%	582,0000	Tržišna cijena	12,61%	1,50%
PODRAVKA PREHRAMBENA INDUSTRIJA D.D.	HRPODRRA0004	10,29%	450,1564	Tržišna cijena	47,16%	2,14%
SUNCE KONCERN d.d. za turizam i ugostiteljstvo	HRSUKCRA0001	15,13%	100,0000	Tržišna cijena	-36,05%	0,58%

Ukupan udio u imovini mirovinskog fonda vrijednosnih papira u kojima mirovinski fond samostalno ili zajednički s drugim fondovima pod upravljanjem istog društva ima udio veći od 10% 5,64%

**Vrijednosni papiri iz članka 125. stavka 1. točka 3., 4. i 5. Zakona u kojima mirovinski fond samostalno ili zajedno s mirovinskim fondovima pod upravljanjem istog mirovinskog društva ima udio u izdanju veći od 10%

Vrijednosni papiri vrednovani metodom procjene na datum 31.10.2020.

Vrijednosni papir / ISIN / Izdavatelj	Procijenjena vrijednost
ATLANTIC 2021 / HRATGRO216A9 / ATLANTIC GRUPA	101,2659 ²
DALEKOVOD 2030 EUR / HRDLKVO302E2 / DALEKOVOD DD	58,2254 ²
DALEKOVOD 2030 HRK / HRDLKVO302A0 / DALEKOVOD DD	53,4739 ²
GRANOLIO / HRGRNLRA0006 / GRANOLIO d.d.	0,0000 ³
HEP 2022 USD / XS1309493630 / HRVATSKA ELEKTROPRIVREDA	109,7731 ²
HTP KORČULA / HRHTPKRA0002 / HTP KORČULA D.D za ugostiteljstvo, turizam, trgovinu i pružanje ostalih usluga	67,8084 ³
MAGMA B / HRMGMARB0004 / MAGMA D.D.	0,0000 ³
MF 2022 / HRRHMFO227E9 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	111,2270 ¹
MF 2024 / HRRHMFO247E7 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	120,6180 ¹
MF 2027 / HRRHMFO275E8 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	100,8970 ¹
MF 2040 / HRRHMFO403E6 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	97,2730 ¹
MF INDEX 2032 / HRRHMFO327A5 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	123,1460 ¹
MF INDEX 2034 / HRRHMFO34BA1 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	97,3450 ¹
MFKN 2021 / HRRHMFO217A8 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	102,0830 ¹
MFKN 2022 / HRRHMFO222A8 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	102,8660 ¹
MFKN 2025 / HRRHMFO257A4 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	119,2180 ¹
MFKN 2026 / HRRHMFO26CA5 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	122,4900 ¹
MFKN 2028 / HRRHMFO282A2 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske	115,5660 ¹
Meritus ulaganja d.d. / HRMRULRA0009 / Meritus Ulaganja d.d. za upravljanje društvima	597,7711 ³
NLB 11_2029 / XS2080776607 / Nova Ljubljanska banka	87,8272 ²
NLB 2029 / SI0022103855 / Nova Ljubljanska banka	103,5261 ²
PLAVA LAGUNA / HRPLAGRA0003 / PLAVA LAGUNA dioničko društvo za ugostiteljstvo i turizam	1225,0267 ³
PROFESSIO ENERGIA / HRDLPRRA0007 / PROFESSIO ENERGIA D.D.	303,6535 ³
USTreasuryN/B T 0 5/8 05/15/30 / US912828ZQ64 / United States of America	97,9141 ¹
ZAGREBAČKI HOLDING 2023 / HRZGHOO237A3 / ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o.	104,2712 ²

Metoda procjene:

1 Zadnja cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu

2 Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa

3 Procjena Društva