

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: 10.930.333,80 eura
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 | 2,63% |
| Prinos za prethodnih godinu dana | 0,84% |
| Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda | 5,46% |

Prinos za tekuću godinu računa se od 31.12.2022. - 28.02.2023.

Prinos za prethodnih godinu dana računa se od 28.02.2022 - 28.02.2023.

Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda računa se od 30.04.2002. - 28.02.2023.

NAV/VOJ

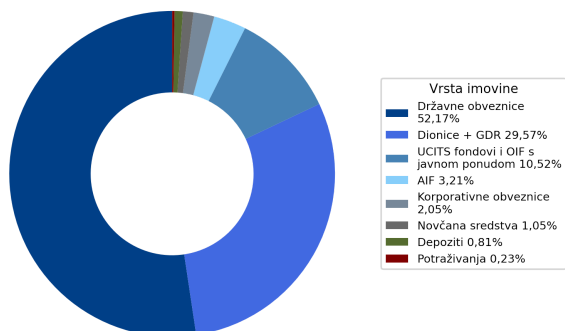
| | |
|---|------------------|
| Neto vrijednost imovine na izvještajni datum | 2.460.388.851,97 |
| Vrijednost obračunske jedinice na izvještajni datum | 40,1111 |

10 najvećih pozicija ulaganja

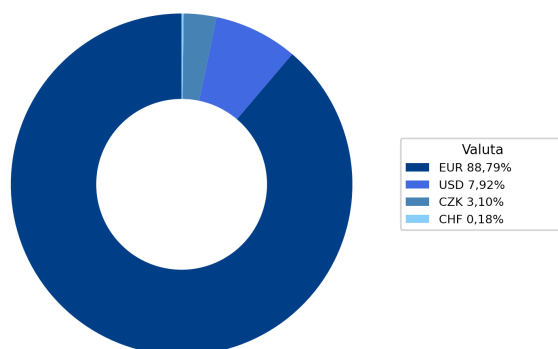
| Financijski instrument | Udio u NaV-u |
|---|--------------|
| H275E (HRRHMFO275E8), MINISTARSTVO FINACIJA | 7,28% |
| H34BA (HRRHMFO34BA1), MINISTARSTVO FINACIJA | 4,23% |
| H26CA (HRRHMFO26CA5), MINISTARSTVO FINACIJA | 4,23% |
| H327E (HRRHMFO327E7), MINISTARSTVO FINACIJA | 4,19% |
| CROATI 2 3/4 01/27/30 (XS1713475306), MINISTARSTVO FINACIJA | 4,05% |
| CZGB 0.45 10/25/23 (CZ0001004600), ČEŠKA REPUBLIKA | 3,09% |
| H282A (HRRHMFO282A2), MINISTARSTVO FINACIJA | 3,00% |
| CROATI 3 03/11/25 (XS1117298916), MINISTARSTVO FINACIJA | 2,72% |
| H257A (HRRHMFO257A4), MINISTARSTVO FINACIJA | 2,50% |
| PODR (HRPODRRA0004), PODRAVKA D.D. | 2,48% |

Struktura imovine fonda

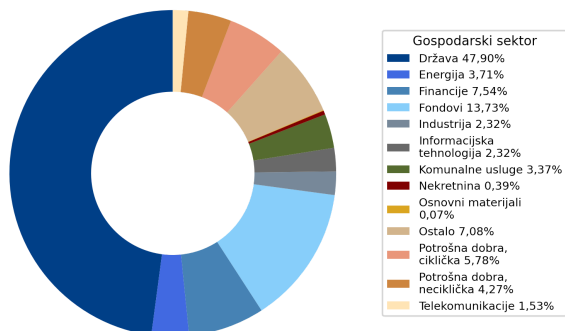
Vrsta imovine



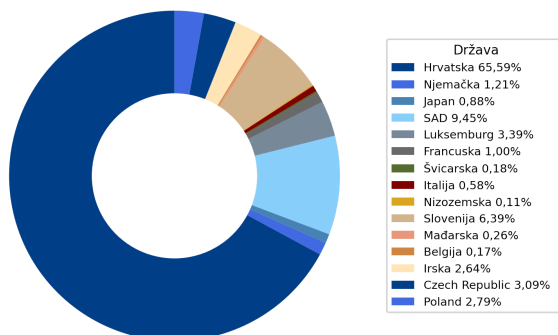
Valutna izloženost



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 | 52,09% |
| Prenosivi dužnički vrijednosni papiri i instrumenti tržišta novca za koje jamči RH, druga država članica ili država članica OECD-a, HNB ili središnja banka | 0,08% |
| 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 | 2,05% |
| Prenosivi vlasnički vrijednosni papiri uvrštenih na uređeno tržište, čiji izdavatelj dioničko društvo sa sjedištem u RH, drugoj državi ili državi članici OECD-a | 29,63% |

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 | 1.106.902.440,62 | 44,99% | -0,29% |

*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 |
|-------------------------------|----------------------------|------------------|------------|-----------------------------------|---|--------------------------|
| Končar-Elektroindustrija d.d. | HRKOEIRA0009 | 15,73% | 127,9146 | Tržišna cijena | 71,23% | 2,07% |
| Quattro logistika d.d. | HRQTLGRA0001 | 18,92% | 1,6500 | Procjena Društva | 24,69% | 0,39% |
| Villa Dubrovnik d.d. | HRVIDURA0009 | 96,07% | 55,8705 | Procjena Društva | 0,92% | 1,78% |
| PROFESSIO ENERGIA D.D. | HRDLPRRA0007 | 51,71% | 38,7186 | Procjena Društva | 41,11% | 2,09% |
| JADRAN D.D. | HRJDRNRB0002 | 30,76% | 1,5182 | Procjena Društva | -33,76% | 0,53% |

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% 6,86%

***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 28.02.2023.

| Vrijednosni papir / ISIN / Izdavatelj | Procijenjena vrijednost |
|---|-------------------------|
| ATLANTIC 2025 / HRATGRO25CA5 / ATLANTIC GRUPA | 92,8016 ² |
| CIAK Grupa / HRCIAKRA0007 / CIAK Grupa d.d. | 6,0164 ³ |
| CROATIA 2027 / XS1428088626 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 98,1540 ¹ |
| CROATIA 2028 / XS1713462668 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 95,0190 ¹ |
| CROATIA 2029 / XS1843434876 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 84,3040 ¹ |
| CROATIA 2030 / XS1713475306 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 92,4050 ¹ |
| CROATIA 2041 / XS2309433899 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 67,8050 ¹ |
| DALEKOVOD 2030 EUR / HRDLKVO302E2 / DALEKOVOD DD | 56,4421 ² |
| DALEKOVOD 2030 HRK / HRDLKVO302A0 / DALEKOVOD DD | 68,4221 ² |
| GRANOLIO / HRGRNLRA0006 / GRANOLIO d.d. | 8,1104 ³ |
| INA 2026 / HRINA0026CA0 / INA INDUSTRIJA NAFTE D.D. | 88,8262 ² |
| JADRAN / HRJDRNRB0002 / JADRAN D.D. | 1,5182 ³ |
| MAGMA B / HRMGMARB0004 / MAGMA D.D. | 0,0000 ³ |
| MF 2024 / HRRHMFO247E7 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 102,9970 ¹ |
| MF 2027 / HRRHMFO275E8 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 89,2390 ¹ |
| MF 2030 / HRRHMFO302E0 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 83,2160 ¹ |
| MF 2032 / HRRHMFO327E7 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 95,4310 ¹ |
| MF 2040 / HRRHMFO403E6 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 63,9480 ¹ |
| MF INDEX 2032 / HRRHMFO327A5 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 94,6950 ¹ |
| MF INDEX 2034 / HRRHMFO34BA1 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 72,0550 ¹ |
| MFKN 2025 / HRRHMFO257A4 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 102,1720 ¹ |
| MFKN 2026 / HRRHMFO26CA5 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 102,5140 ¹ |
| MFKN 2028 / HRRHMFO282A2 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 96,4890 ¹ |
| MFKN 2029 / HRRHMFO297A0 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 91,5360 ¹ |
| MFKN 7_2028 / HRRHMFO287A1 / Ministarstvo financija Republike Hrvatske | 84,7460 ¹ |
| Meritus ulaganja 2027 / HRMRULO277E9 / Meritus Ulaganja d.d. za upravljanje društvima | 96,5103 ² |
| Meritus ulaganja d.d. / HRMRULRA0009 / Meritus Ulaganja d.d. za upravljanje društvima | 111,4327 ³ |
| NLB 11_2029 / XS2080776607 / Nova Ljubljanska banka | 85,5042 ² |
| NLB 2029 / SI0022103855 / Nova Ljubljanska banka | 90,4176 ² |
| PROFESSIO ENERGIA / HRDLPRRA0007 / PROFESSIO ENERGIA D.D. | 38,7186 ³ |
| Poland 2028 / XS1508566392 / Republika Poljska | 85,3500 ¹ |
| Quattro logistika d.d. / HRQTLGRA0001 / Quattro logistika d.d. | 1,6500 ³ |
| Villa Dubrovnik / HRVIDURA0009 / Villa Dubrovnik d.d. | 55,8705 ³ |
| ZAGREBAČKI HOLDING 2023 / HRZGHOO237A3 / ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o. | 100,0070 ² |

Metoda procjene: 1 Zadnja cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu; 2 Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa; 3 Procjena Društva; Datum procjene 06.02.2023.