

Osnovne informacije o fondu

Naziv fonda: Erste Plavi obvezni mirovinski fond kategorije B
OIB fonda: 37688683890
OIB mirovinskog društva: 49659289650
Temeljni kapital mirovinskog društva: 82.354.600,00 kuna
Neto vrijednost imovine na 31.12.2016.: 11.007.709.209,95 kuna
Vrijednost obračunske jedinice na 31.12.2016.: 242,2971
Tko može biti član fonda?

Članovi mogu biti svi kojima je ostalo 5 ili više godina do pune starosne mirovine.

Strategija ulaganja i investicijski cilj fonda

Fond kategorije B minimalno 50% neto imovine fonda ulaže u obveznice Republike Hrvatske, članica EU ili OECD zemalja, a maksimalno 35% neto imovine može biti uloženo u dionice izdavatelja iz Republike Hrvatske, članica EU ili OECD zemalja. Minimalno 60% imovine fonda mora biti u kunama.

Investicijski cilj fonda jest rast vrijednosti uložених novčanih sredstava na srednji rok, umjereno konzervativnom strategijom ulaganja, radi osiguranja isplate mirovinskih davanja članovima Fonda. Investicijski cilj se ostvaruje pretežnim ulaganjem u dužničke vrijednosne papire, vlasničke vrijednosne papire i udjele investicijskih fondova, sukladno ograničenjima ulaganja iz Zakona, podzakonskih akata i Statuta

Osnovna načela i ograničenja 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 raspršenosti 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.

10 NAJVEĆIH POZICIJA ULAGANJA

Financijski instrument

RHMF-O-26CA (MFKN 2026 4,25% 14/12/26)
RHMF-O-227E (RHMF 6,50% 22/07/2022)
RHMF-O-172A (RHMF 2017 4,75% 08/02/2017)
RHMF-O-203E (RHMF 2020 6,5% 05/03/2020)
RHMF-O-187A (RHMF 2018 5,25% 10/7/2018)
RHMF-O-257A (MFKN 2025 4,5% 9/7/25)
RHMF-O-19BA (RHMF 2019 5,375% 29/11/2019)
CROATIA 2025 (CROATIA 3% 03/11/25)
CROATIA 2022 (CROATI 3 7/8 05/30/22)
CROATIA 2019 USD (CROATI6 3/4 11/19)

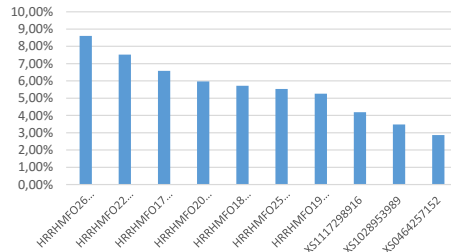
ISIN

HRRHMFO26CA5
HRRHMFO227E9
HRRHMFO172A5
HRRHMFO203E0
HRRHMFO187A3
HRRHMFO257A4
HRRHMFO19BA2
XS1117298916
XS1028953989
XS0464257152

Udio u NAV-u

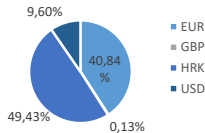
8,61%
7,52%
6,58%
5,97%
5,72%
5,53%
5,26%
4,19%
3,48%
2,87%

10 najvećih pozicija



VALUTNA STRUKTURA PORTFELJA

EUR 40,84%
GBP 0,13%
HRK 49,43%
USD 9,60%

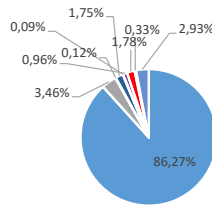


PODACI O PRINOSU FONDA

Prinos za tekuću godinu	8,08%
Prinos za prethodnih godinu dana	8,08%
Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda	6,22%

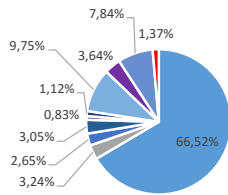
STRUKTURA IMOVINE FONDA PREMA DRŽAVAMA

Hrvatska 86,27%
Njemačka 3,46%
Velika Britanija 0,12%
SAD 1,75%
Austrija 0,09%
Luksemburg 0,96%
Francuska 1,78%
Italija 0,33%
Slovenija 2,93%



STRUKTURA IMOVINE FONDA PREMA GOSPODARSKIM SEKTORIMA

Država 66,52%
Energija 3,24%
Financije 2,65%
Industrija 3,05%
Informacijska tehnologija 0,83%
Komunalne usluge 1,12%
Ostalo 9,75%
Potrošna dobra, ciklička 3,64%
Potrošna dobra, neciklička 7,84%
Telekomunikacije 1,37%



STRUKTURA PREMA VRSTI PRENOSIVIH VRIJEDNOSNIH PAPIRA

Prenosivi dužnički vrijednosni papiri i instrumenti tržišta novca čiji je izdavatelj RH, druga država članica ili država članica OECD-a	65,51%
Prenosivi dužnički vrijednosni papiri i instrumenti tržišta novca za koje jamči RH, druga država članica ili država članica OECD-a, HNB ili središnja banka	1,20%
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	3,98%
Prenosivi vlasnički vrijednosni papiri uvrštenih na uređeno tržište, čiji izdavatelj dioničko društvo sa sjedištem u RH, drugoj državi ili državi članici OECD-a	21,31%

Prinos za tekuću godinu se računa od 31.12.2015. – 31.12.2016.

Prinos za prethodnih godinu dana računa se od 31.12.2015. – 31.12.2016.

Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda računa se od 21.08.2014. – 31.12.2016.

Rezultati poslovanja mirovinskog fonda ostvareni u proteklim razdobljima ne predstavljaju indikaciju i nemaju nikakav utjecaj na buduće rezultate poslovanja mirovinskog fonda. Nominalni prinos mirovinskog fonda je postotna razlika između vrijednosti obračunske jedinice na zadnji radni dan zadnjeg mjeseca tekućeg tromjesečja i vrijednosti te jedinice na zadnji radni dan prije 12 mjeseci.

Računa se na sljedeći način:

$$R(\text{nom}) = \frac{(\text{Voj2} - \text{Voj1})}{\text{Voj1}} * 100$$

R(nom) = nominalni prinos Fonda

Voj1 = vrijednost te jedinice na zadnji radni dan prije 12 mjeseci.

Voj2 = vrijednost obračunske jedinice na zadnji radni dan zadnjeg mjeseca tekućeg tromjesečja

STRUKTURA IMOVINE PREMA VRSTAMA IMOVINE

DOMAĆA IMOVINA	86,75%
Vrijednosni papiri i depoziti	84,59%
Dionice + GDR	14,96%
Državne obveznice	66,71%
Korporativne obveznice	2,30%
AIF	0,42%
UCITS fondovi	0,20%
Instrumenti tržišta novca	1,68%
Novčana sredstva	0,48%
Potraživanja	0,01%
INOZEMNA IMOVINA	13,33%
Dionice	6,35%
UCITS fondovi	5,07%
Novčana sredstva	1,90%
Potraživanja	0,02%
UKUPNA IMOVINA	100,08%

VRJEDNOSNI PAPIRI VREDNOVANI METODOM PROCJENE

Vrijednosni papir	Izdavatelj	ISIN	Procijenjena vrijednost	Datum procjene	Metoda procjene
DLKV-O-302A	Dalekovod d.d.	HRDLKVO302A0	63,9976	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
DLKV-O-302E	Dalekovod d.d.	HRDLKVO302E2	54,5696	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
FNOI-D-177A	Fond za naknadu oduzete imovine	HRFNOID177A8	96,4191	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
FNOI-D-181A	Fond za naknadu oduzete imovine	HRFNOID181A0	97,7584	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
FNOI-D-187A	Fond za naknadu oduzete imovine	HRFNOID187A7	96,1377	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
FNOI-D-191A	Fond za naknadu oduzete imovine	HRFNOID191A9	86,8266	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
FNOI-D-197A	Fond za naknadu oduzete imovine	HRFNOID197A6	83,3897	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
HP-O-198A	Hrvatska pošta d.d.	HRHP000198A4	105,8036	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
IGH-O-176A	Institut IGH d.d.	HRIGH00176A8	30,0000	3.1.2017	Odluka Društva
LNGU-O-31AE	LANIŠTE d.o.o.	HRLNGUO31AE3	16,8300	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
HRELEC 5 7/8 10/23/22	Hrvatska elektroprivreda d.d.	XS1309493630	105,7979	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
QUNE-R-A	Quaestus nekretnine d.d. u likvidaciji	HRQUNERA0008	7,0000	3.1.2017	Posljednja relevantna tržišna cijena
MGMA-R-B	Magma d.d.	HRMGMARB0004	0,0000	3.1.2017	Odluka Društva
ULJN-R-A	Uljanik d.d.	HRULJNRA0008	46,9945	3.1.2017	Posljednja relevantna tržišna cijena
GRNL-R-A	Granolio d.d.	HRGRNLRA0006	109,9923	3.1.2017	Posljednja relevantna tržišna cijena
HTPK-R-A	HTP Korčula d.d.	HRHTPKRA0002	67,7000	3.1.2017	Metoda diskontiranog novčanog toka
ATGR-O-216A	Atlantic Grupa d.d.	HRATGRO216A9	102,5588	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
ZGHO-O-237A	Zagrebački holding d.o.o.	HRZGHOO237A3	102,5740	3.1.2017	Raspon na odgovarajuću krivulju prinosa
RHMF-O-172A	Ministarstvo financija Republike Hrvatske	HRRHMFO172A5	100,4050	3.1.2017	Zadnja cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu
RHMF-O-203A	Ministarstvo financija Republike Hrvatske	HRRHMFO203A8	115,5920	3.1.2017	Zadnja cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu
HBOR 2017	Republika Hrvatska	XS0305384124	100,8450	3.1.2017	Zadnja cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu
HBOR 2020	Republika Hrvatska	XS0961637542	111,9020	3.1.2017	Zadnja cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu
CROATIA 2019	Republika Hrvatska	XS0464257152	108,8280	3.1.2017	Zadnja cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu
CROATIA 2021	Republika Hrvatska	XS0607904264	109,1770	3.1.2017	Zadnja cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu
CROATIA 2023	Republika Hrvatska	XS0908769887	105,9590	3.1.2017	Zadnja cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu
CROATIA 2022	Republika Hrvatska	XS1028953989	108,2040	3.1.2017	Zadnja cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu