

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 indicaciju i nemaju nikakav utjecaj na buduće rezultate poslovanja mirovinskog fonda.

| | |
|--|--------|
| Prinos za tekuću godinu | -5,48% |
| Prinos za prethodnih godinu dana | -0,05% |
| Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda | 5,60% |

Prinos za tekuću godinu računa se od 31.12.2019. - 30.04.2020.

Prinos za prethodnih godinu dana računa se od 30.04.2019 - 30.04.2020.

Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda računa se od 30.04.2002. - 30.04.2020.

NAV/VOJ

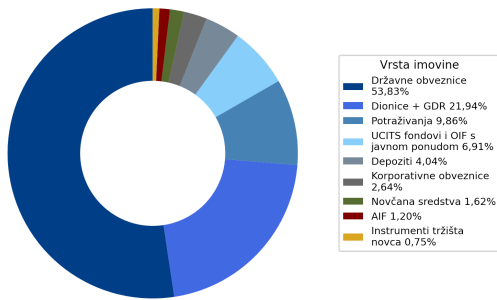
| | |
|---|-------------------|
| Neto vrijednost imovine na izvještajni datum | 14.592.722.257,34 |
| Vrijednost obračunske jedinice na izvještajni datum | 266,7817 |

10 najvećih pozicija ulaganja

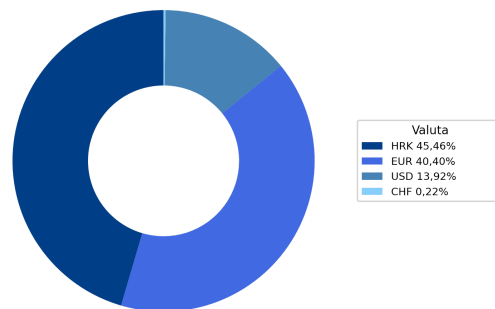
| Financijski instrument | Udio u NaV-u |
|---|--------------|
| H227E (HRRHMFO227E9), MINISTARSTVO FINACIJA | 5,72% |
| H34BA (HRRHMFO34BA1), MINISTARSTVO FINACIJA | 5,70% |
| CROATI 2 3/4 01/27/30 (XS1713475306), RH | 5,38% |
| H23BA (HRRHMFO23BA4), MINISTARSTVO FINACIJA | 5,20% |
| H257A (HRRHMFO257A4), MINISTARSTVO FINACIJA | 4,43% |
| H26CA (HRRHMFO26CA5), MINISTARSTVO FINACIJA | 4,30% |
| CROATI 3 03/11/25 (XS1117298916), RH | 3,61% |
| H403E (HRRHMFO403E6), MINISTARSTVO FINACIJA | 3,29% |
| CROATI 3 03/20/27 (XS1428088626), RH | 2,53% |
| CROATI5 1/2 04/23 (XS0908769887), RH | 2,14% |

Struktura imovine fonda

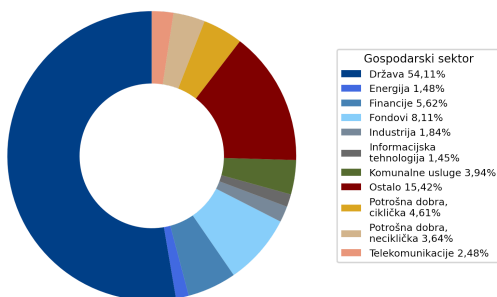
Vrsta imovine



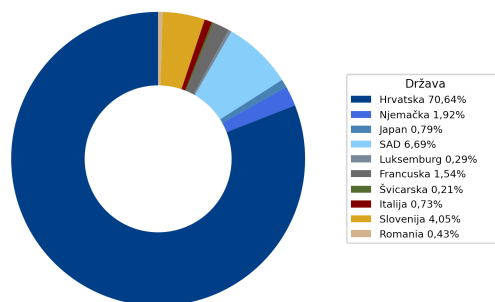
Valutna izloženost



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 | 54,11% |
| Prenosivi dužnički vrijednosni papiri i instrumenti tržišta novca za koje jamči RH, druga država članica ili država članica OECD-a, HNB ili središnja banka | 0,48% |
| 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 | 2,64% |
| Prenosivi vlasnički vrijednosni papiri uvrštenih na uređeno tržište, čiji izdavatelj dioničko društvo sa sjedištem u RH, drugoj državi ili državi članici OECD-a | 21,94% |

Vrijednosni papiri vrednovani metodom procjene na datum 01.04.2020.

| Vrijednosni papir / ISIN / Izdavalac | Procijenjena vrijednost |
|---|-------------------------|
| ATLANTIC 2021 / HRATGRO216A9 / ATLANTIC GRUPA | 99,9940 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 ⁴ |
| HEP 2022 USD / XS1309493630 / HRVATSKA ELEKTROPRIVREDA | 109,5947 ² |
| HTP KORČULA / HRHTPKRA0002 / HTP KORČULA D.D za ugostiteljstvo, turizam, trgovinu i pružanje ostalih usluga | 67,7567 ³ |
| Luka Rijeka d.d. / HRLKRIRA0007 / Luka Rijeka d.d. | 36,1248 ³ |
| MAGMA B / HRMGMARB0004 / MAGMA D.D. | 0,0000 ⁴ |
| Mercator poslovni sistem / SI0031100082 / Mercator poslovni sistem | 35,7703 ³ |
| Meritus ulaganja d.d. / HRMRULRA0009 / Meritus Ulaganja d.d. za upravljanje društvima | 265,0189 ³ |
| NLB 11_2029 / XS2080776607 / Nova Ljubljanska banka | 103,9507 ² |
| NLB 2029 / SI0022103855 / Nova Ljubljanska banka | 103,5261 ² |
| PROFESSIO ENERGIA / HRDLPRRA0007 / PROFESSIO ENERGIA D.D. | 234,8380 ³ |
| ZAGREBAČKI HOLDING 2023 / HRZGHOO237A3 / ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o. | 106,1312 ² |

Metoda procjene: 1 Cijena s finansijsko-informacijskog servisa; 2 Interni model vrednovanja - raspon na odgovarajuću krivulju prinosa; 3 Metoda tržišnih multiplikatora; 4 Interni model vrednovanja - odluka Društva