

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	0,17%
Prinos za prethodnih godinu dana	9,80%
Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda	5,92%

Prinos za tekuću godinu računa se od 31.12.2021. - 31.01.2022.

Prinos za prethodnih godinu dana računa se od 31.01.2021 - 31.01.2022.

Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda računa se od 30.04.2002. - 31.01.2022.

NAV/VOJ

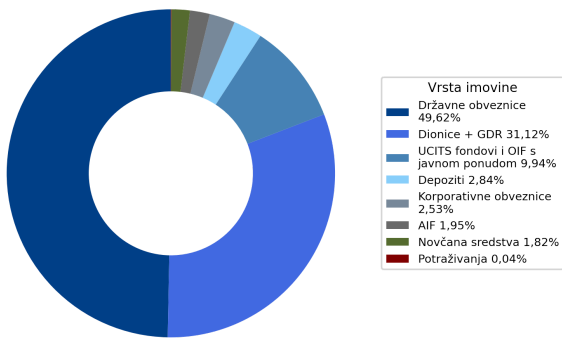
Neto vrijednost imovine na izvještajni datum	18.317.503.820,21
Vrijednost obračunske jedinice na izvještajni datum	311,0785

10 najvećih pozicija ulaganja

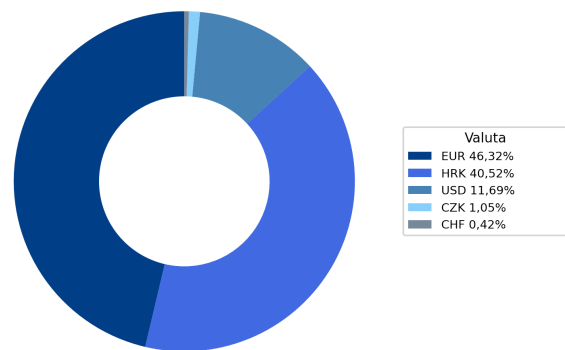
Financijski instrument	Udio u NaV-u
H275E (HRRHMFO275E8), MINISTARSTVO FINACIJA	7,61%
H26CA (HRRHMFO26CA5), MINISTARSTVO FINACIJA	4,93%
H34BA (HRRHMFO34BA1), MINISTARSTVO FINACIJA	4,54%
H227E (HRRHMFO227E9), MINISTARSTVO FINACIJA	4,52%
CROATI 2 3/4 01/27/30 (XS1713475306), RH	4,03%
H282A (HRRHMFO282A2), MINISTARSTVO FINACIJA	3,23%
CROATI 3 03/11/25 (XS1117298916), RH	3,02%
DEPOZIT U ZAGREBAČKA BANKA DOSPIJEĆE: 03.02.2022	2,84%
H257A (HRRHMFO257A4), MINISTARSTVO FINACIJA	2,84%
PETG SV (SI0031102153), PETROL	2,77%

Struktura imovine fonda

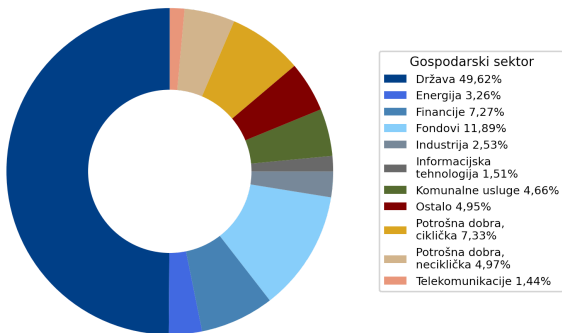
Vrsta imovine



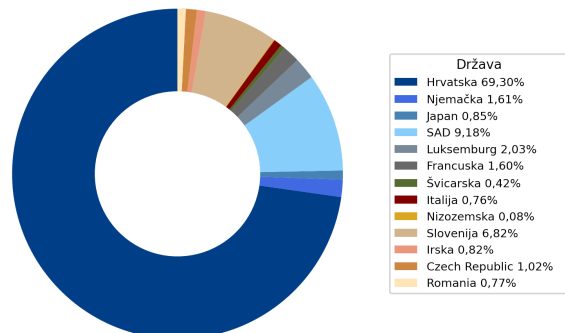
Valutna izloženost



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	49,62%
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	2,53%
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	8.707.223.973,05	47,53%	13,99%

*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 izdavatelju	Vrijednost	Tehnika procjene / tržišna cijena	% prinosa u odnosu na ukupan trošak stjecanja	Udio u mirovinskom fondu
Končar-Elektroindustrija d.d.	HRKOEIRA0009	15,73%	899,2508	Tržišna cijena	68,87%	1,96%
PROFESSIO ENERGIA D.D.	HRDLPRRB0006	52,42%	273,4966	Tržišna cijena	2,05%	1,22%
PROFESSIO ENERGIA D.D.	HRDLPRRA0007	50,00%	273,4966	Metoda tržišnih multiplikatora	79,80%	0,49%
Quattro logistika d.d.	HRQTLGRA0001	18,92%	10,0000	Metoda tržišnih multiplikatora	0,00%	0,32%
SUNCE KONCERN d.d. za turizam i ugostiteljstvo	HRSUKCRA0001	15,15%	185,0351	Metoda tržišnih multiplikatora	15,29%	1,06%
Villa Dubrovnik d.d.	HRVIDURA0009	95,80%	417,1236	Metoda tržišnih multiplikatora	-0,00%	1,78%
JADRAN D.D.	HRJDRNRB0002	30,76%	13,0333	Tržišna cijena	-24,52%	0,61%

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% 7,44%

***Vrijednosni papiri iz članka 125. stavka 1. točaka 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 31.12.2021.

Vrijednosni papir / ISIN / Izdavatelj	Procijenjena vrijednost
ATLANTIC 2025 / HRATGRO25CA5 / ATLANTIC GRUPA	100,3696 ²
CIAK Grupa / HRCIAKRA0007 / CIAK Grupa d.d.	47,3439 ³
DALEKOVOD 2030 EUR / HRDLKVO302E2 / DALEKOVOD DD	57,0740 ²
DALEKOVOD 2030 HRK / HRDLKVO302A0 / DALEKOVOD DD	53,4739 ²
GRANOLIO / HRGRNLRA0006 / GRANOLIO d.d.	26,7643 ³
HEP 2022 USD / XS1309493630 / HRVATSKA ELEKTROPRIVREDA	102,9848 ²
MAGMA B / HRMGMARB0004 / MAGMA D.D.	0,0000
Meritus ulaganja d.d. / HRMRULRA0009 / Meritus Ulaganja d.d. za upravljanje društvima	1016,5289 ³
NLB 11_2029 / XS2080776607 / Nova Ljubljanska banka	99,9212 ²
NLB 2029 / SI0022103855 / Nova Ljubljanska banka	103,5261 ²
PROFESSIO ENERGIA / HRDLPRRA0007 / PROFESSIO ENERGIA D.D.	273,4966 ³
Quattro logistika d.d. / HRQTLGRA0001 / Quattro logistika d.d.	10,0000 ³
SUNCE KONCERN dd / HRSUKCRA0001 / SUNCE KONCERN d.d. za turizam i ugostiteljstvo	185,0351 ³
Villa Dubrovnik / HRVIDURA0009 / Villa Dubrovnik d.d.	417,1236 ³
ZAGREBAČKI HOLDING 2023 / HRZGHOO237A3 / ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o.	99,6992 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