

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	-5,34%
Prinos za prethodnih godinu dana	-2,02%
Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda	5,49%

Prinos za tekuću godinu računa se od 31.12.2021. - 30.06.2022.

Prinos za prethodnih godinu dana računa se od 30.06.2021 - 30.06.2022.

Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda računa se od 30.04.2002. - 30.06.2022.

NAV/VOJ

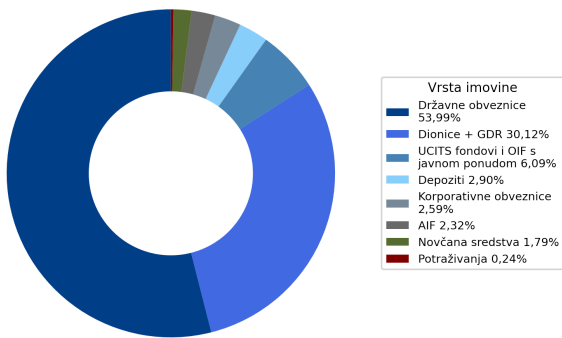
Neto vrijednost imovine na izvještajni datum	17.588.339.420,71
Vrijednost obračunske jedinice na izvještajni datum	293,9695

10 najvećih pozicija ulaganja

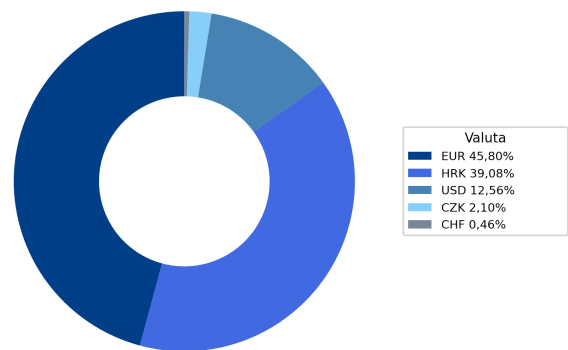
Financijski instrument	Udio u NaV-u
H275E (HRRHMFO275E8), MINISTARSTVO FINACIJA	7,71%
H227E (HRRHMFO227E9), MINISTARSTVO FINACIJA	4,69%
H26CA (HRRHMFO26CA5), MINISTARSTVO FINACIJA	4,66%
H34BA (HRRHMFO34BA1), MINISTARSTVO FINACIJA	4,46%
CROATI 2 3/4 01/27/30 (XS1713475306), MINISTARSTVO FINACIJA	4,31%
H282A (HRRHMFO282A2), MINISTARSTVO FINACIJA	3,24%
CROATI 3 03/11/25 (XS1117298916), MINISTARSTVO FINACIJA	2,92%
H257A (HRRHMFO257A4), MINISTARSTVO FINACIJA	2,81%
PETG SV (SI0031102153), PETROL	2,54%
VIDU (HRVIDURA0009), VILLA DUBROVNIK D.D.	2,31%

Struktura imovine fonda

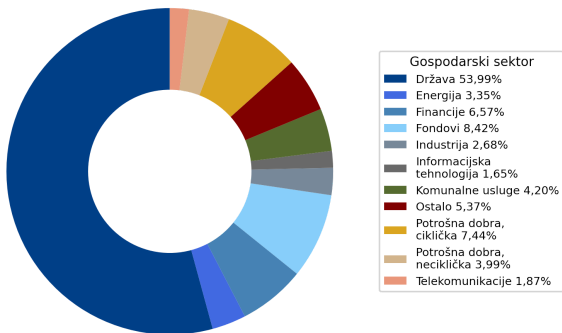
Vrsta imovine



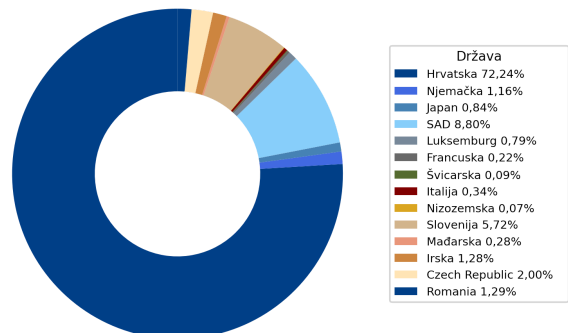
Valutna izloženost



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	53,99%
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	2,59%
Prenosivi vlasnički vrijednosni papiri uvrštenih na uređeno tržište, čiji izdavatelj dioničko društvo sa sjedištem u RH, drugoj državi ili državi članici OECD-a	28,83%

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	8.788.911.255,67	49,97%	7,76%

*Vrijednosni papiri iz članka 125. stavka 1. točka 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%	875,2655	Tržišna cijena	64,65%	1,98%
PROFESSIO ENERGIA D.D.	HRDLPRRB0006	52,42%	266,1887	Metoda tržišnih multiplikatora	-0,30%	1,24%
PROFESSIO ENERGIA D.D.	HRDLPRRA0007	50,00%	266,1887	Metoda tržišnih multiplikatora	76,17%	0,50%
Quattro logistika d.d.	HRQTLGRA0001	18,92%	13,7231	Metoda tržišnih multiplikatora	37,23%	0,46%
SUNCE KONCERN d.d. za turizam i ugostiteljstvo	HRSUKCRA0001	15,28%	158,8240	Metoda tržišnih multiplikatora	-1,04%	0,95%
Villa Dubrovnik d.d.	HRVIDURA0009	95,80%	518,1785	Metoda tržišnih multiplikatora	24,23%	2,31%
JADRAN D.D.	HRJDRNRB0002	30,76%	13,3333	Tržišna cijena	-22,78%	0,65%

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% 8,08%

**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 30.06.2022.

Vrijednosni papir / ISIN / Izdavatelj	Procijenjena vrijednost
ATLANTIC 2025 / HRATGRO25CA5 / ATLANTIC GRUPA	93,7344 ²
CIAK Grupa / HRCIAKRA0007 / CIAK Grupa d.d.	52,8925 ³
DALEKOVOD 2030 EUR / HRDLKVO302E2 / DALEKOVOD DD	53,0364 ²
DALEKOVOD 2030 HRK / HRDLKVO302A0 / DALEKOVOD DD	66,1935 ²
GRANOLIO / HRGRNLRA0006 / GRANOLIO d.d.	52,9182 ³
HEP 2022 USD / XS1309493630 / HRVATSKA ELEKTROPRIVREDA	100,9118 ²
INA 2026 / HRINA0026CA0 / INA INDUSTRIJA NAFTE D.D.	95,1664 ²
Luka Rijeka d.d. / HRLKRIRA0007 / Luka Rijeka d.d.	39,0686 ³
MAGMA B / HRMGMARB0004 / MAGMA D.D.	0,0000 ⁴
Meritus ulaganja d.d. / HRMRULRA0009 / Meritus Ulaganja d.d. za upravljanje društvima	771,2852 ³
NLB 11_2029 / XS2080776607 / Nova Ljubljanska banka	98,0707 ²
NLB 2029 / SI0022103855 / Nova Ljubljanska banka	98,2239 ²
PROFESSIO ENERGIA / HRDLPRRA0007 / PROFESSIO ENERGIA D.D.	266,1887 ³
PROFESSIO ENERGIA B dionice / HRDLPRRB0006 / PROFESSIO ENERGIA D.D.	266,1887 ³
Quattro logistika d.d. / HRQTLGRA0001 / Quattro logistika d.d.	13,7231 ³
SUNCE KONCERN dd / HRSUKCRA0001 / SUNCE KONCERN d.d. za turizam i ugostiteljstvo	158,8240 ³
Villa Dubrovnik / HRVIDURA0009 / Villa Dubrovnik d.d.	518,1785 ³
ZAGREBAČKI HOLDING 2023 / HRZGHOO237A3 / ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o.	96,6622 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