

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 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.

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 proteklom razdoblju ne predstavljaju indicaciju i nemaju nikakav utjecaj na buduće rezultate poslovanja mirovinskog fonda.

Prinos za tekuću godinu	9,25%
Prinos za prethodnih godinu dana	11,89%
Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda	5,61%

Prinos za tekuću godinu računa se od 31.12.2022. - 30.09.2023.

Prinos za prethodnih godinu dana računa se od 30.09.2022 - 30.09.2023.

Prosječni godišnji prinos od osnutka mirovinskog fonda računa se od 30.04.2002. - 30.09.2023.

NAV/VOJ

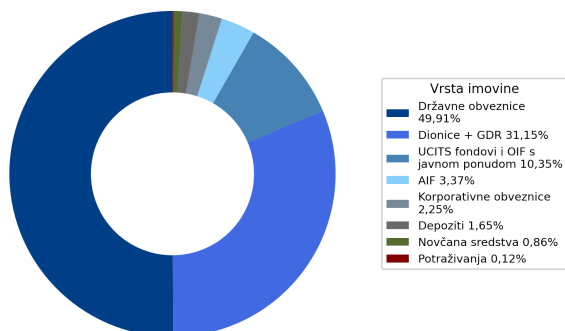
Neto vrijednost imovine na izvještajni datum	2.682.132.866,87
Vrijednost obračunske jedinice na izvještajni datum	42,6982

10 najvećih pozicija ulaganja

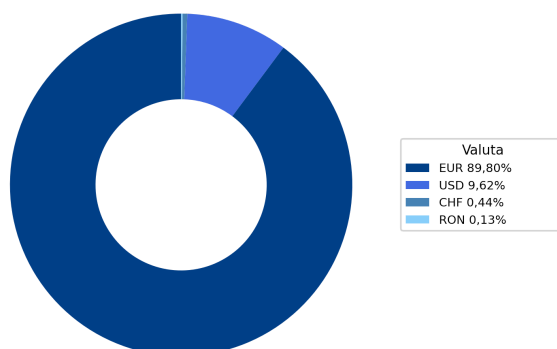
Financijski instrument	Udio u NaV-u
H275E (HRRHMFO275E8), MINISTARSTVO FINACIJA	6,69%
H34BA (HRRHMFO34BA1), MINISTARSTVO FINACIJA	3,90%
H327E (HRRHMFO327E7), MINISTARSTVO FINACIJA	3,87%
H26CA (HRRHMFO26CA5), MINISTARSTVO FINACIJA	3,85%
CROATI 2 3/4 01/27/30 (XS1713475306), MINISTARSTVO FINACIJA	3,78%
PODR (HRPODRRA0004), PODRAVKA D.D.	3,46%
H282A (HRRHMFO282A2), MINISTARSTVO FINACIJA	2,81%
KOEI (HRKOEIRA0009), KONČAR D.D.	2,72%
CROATI 3 03/11/25 (XS1117298916), MINISTARSTVO FINACIJA	2,46%
H257A (HRRHMFO257A4), MINISTARSTVO FINACIJA	2,32%

Struktura imovine fonda

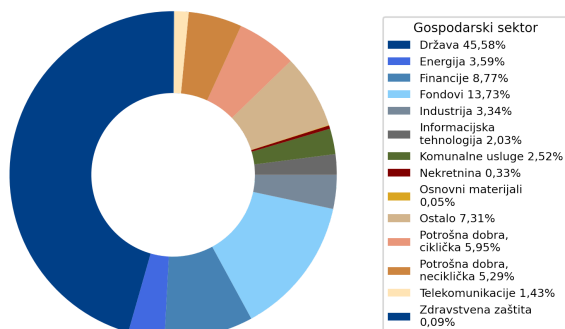
Vrsta imovine



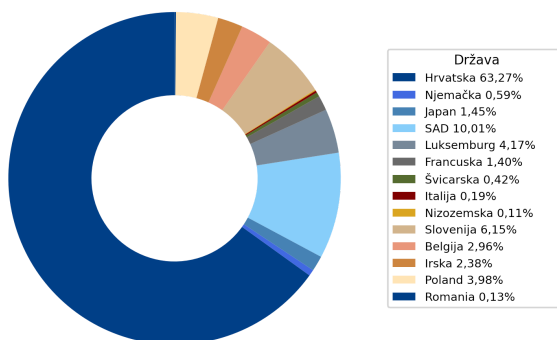
Valutna izloženost



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 izdavalatelj RH, druga država članica ili država članica OECD-a	49,44%
Prenosivi dužnički vrijednosni papiri i instrumenti tržišta novca za koje jamči RH, druga država članica ili država članica OECD-a, HNB ili središnja banka	0,47%
Prenosivi dužnički vrijednosni papiri i instrumenti tržišta novca uvrštenih na uređeno tržište, čiji izdavalatelj ima sjedište u RH, drugoj državi ili državi članici OECD-a	2,25%
Prenosivi vlasnički vrijednosni papiri uvrštenih na uređeno tržište, čiji izdavalatelj dioničko društvo sa sjedištem u RH, drugoj državi ili državi članici OECD-a	31,20%

Udio u neto vrijednosti imovine veći od 10%*

Izdavalatelj	Vrijednost svih vrijednosnih papira izdavalatelja u mirovinskom fondu	Udio u neto imovini mirovinskog fonda	% prinosa u odnosu na ukupan trošak stjecanja
Ministarstvo financija Republike Hrvatske	1.123.645.906,84	41,89%	0,60%

*Vrijednosni papiri iz članka 125. stavka 1. točka 1. i 2. izdani od strane jednog izdavalatelja, 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	15,79%	183,0000 Tržišna cijena	162,03%	2,72%
Quattro logistika d.d.	HRQTLGRA0001	18,92%	1,5204 Metoda diskontiranog novčanog toka	21,12%	0,33%
Villa Dubrovnik d.d.	HRVIDURA0009	88,38%	56,6879 Metoda diskontiranog novčanog toka	2,40%	1,66%
PROFESSIO ENERGIA D.D.	HRDLPRRA0007	51,71%	43,3401 Metoda diskontiranog novčanog toka	75,19%	2,14%
JADRAN D.D.	HRJDRNRB0002	30,76%	Vaganim prosjekom dvije metode, 1,6961 metoda diskontiranog novčanog toka i metoda tržišnih multiplikatora	-25,99%	0,54%
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%					7,39%

**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 30.09.2023.

Vrijednosni papir / ISIN / Izdavatelj	Procijenjena vrijednost
ATLANTIC 2025 / HRATGRO25CA5 / ATLANTIC GRUPA	93,3057 ²
CIAK Grupa / HRCIAKRA0007 / CIAK Grupa d.d.	6,4423 ⁶
DALEKOVOD 2030 EUR / HRDLKVO302E2 / DALEKOVOD DD	56,5207 ²
DALEKOVOD 2030 HRK / HRDLKVO302A0 / DALEKOVOD DD	67,9399 ²
GRANOLIO / HRGRNLRA0006 / GRANOLIO d.d.	7,0368 ⁶
INA 2026 / HRINA0026CA0 / INA INDUSTRIJA NAFTE D.D.	90,0107 ²
JADRAN / HRJDRNRB0002 / JADRAN D.D.	1,6961 ⁵
MAGMA B / HRMGMARB0004 / MAGMA D.D.	0,0000 ⁴
Meritus ulaganja 2027 / HRMRULO277E9 / Meritus Ulaganja d.d. za upravljanje društvima	98,4439 ²
Meritus ulaganja d.d. / HRMRULRA0009 / Meritus Ulaganja d.d. za upravljanje društvima	148,8486 ⁶
NLB 11_2029 / XS2080776607 / Nova Ljubljanska banka	87,1292 ²
NLB 2029 / SI0022103855 / Nova Ljubljanska banka	94,5168 ²
PROFESSIO ENERGIA / HRDLPRRA0007 / PROFESSIO ENERGIA D.D.	43,3401 ⁶
Quattro logistika / HRQTLGRA0001 / Quattro logistika d.d.	1,5204 ⁶
Villa Dubrovnik / HRVIDURA0009 / Villa Dubrovnik d.d.	56,6879 ⁶

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; 5 Vaganim prosjekom dvije metode, metoda diskontiranog novčanog toka i metoda tržišnih multiplikatora; 6 Metoda diskontiranog novčanog toka