

Popis ulaganja obveznog mirovinskog fonda

PBZ CROATIA OSIGURANJE obvezni mirovinski fond – kategorija C

Datum: 30.6.2018.

Pozicija	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Novčana sredstva - Addiko Bank d.d.	1.154.502,29	0,18%
Potraživanja	112,50	0,00%

Fer vrijednost kroz račun dobiti i gubitka					
Pozicija	Količina	Cijena	Metoda vrednovanja	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Dugoročne obveznice RH-OTHER(FVPL)				482.412.214,20	73,98%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	71.302.750,00	117,44	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	83.868.998,60	12,86%
RHMF-O-282A (HRRHMFO282A2) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	65.700.000,00	105,30	Tržišna cijena	69.928.257,80	10,72%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	46.200.000,00	117,50	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	55.271.426,15	8,48%
RHMF-O-217A (HRRHMFO217A8) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	42.000.000,00	106,66	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	45.347.495,14	6,95%
RHMF-O-19BA (HRRHMFO19BA2) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	107,27	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	39.753.556,74	6,10%
CRO 3,875%22EUR (XS1028953989) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.950.000,00	110,79	Tržišna cijena	32.390.183,52	4,97%
CRO 3,00%25EUR (XS1117298916) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.594.000,00	106,94	Tržišna cijena	28.604.279,65	4,39%
RHMF-O-203E (HRRHMFO203E0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.324.018,00	110,43	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	27.595.237,76	4,23%
RHMF-O-23BA (HRRHMFO23BA4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	20.400.000,00	103,84	Tržišna cijena	21.216.343,70	3,25%
CRO 2,7%28EUR (XS1713462668) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.150.000,00	99,50	Tržišna cijena	15.804.999,61	2,42%
RHMF-O-222A (HRRHMFO222A8) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	14.000.000,00	104,94	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	14.815.893,70	2,27%
CRO 2,75%30EUR (XS1713475306) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.000.000,00	98,43	Tržišna cijena	14.766.218,17	2,26%
CRO 6,375%21USD (XS0607904264) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.600.000,00	106,12	Tržišna cijena	10.931.761,25	1,68%
CRO 6,75%19USD (XS0464257152) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.600.000,00	104,35	Tržišna cijena	10.683.798,32	1,64%
RHMF-O-227E (HRRHMFO227E9) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	959.422,00	122,36	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	8.865.310,11	1,36%
CRO 6,625%20USD (XS0525827845) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	350.000,00	105,38	Tržišna cijena	2.404.759,54	0,37%
RHMF-D-187A (HRRHMFD187A6) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	10.142,41	100,00	Interni model vrednovanja	74.846,11	0,01%
RHMF-D-191A (HRRHMFD191A8) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	7.200,16	99,86	Interni model vrednovanja	53.060,19	0,01%

RHMF-D-197A (HRRHMF197A5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	4.857,72	99,83	Interni model vrednovanja	35.788,14	0,01%
Dugoročne korporativne obveznice iz RH-OTHER(FVPL)				31.394.569,84	4,81%
HEP 2022 USD (XS1309493630) HRVATSKA ELEKTROPRIVREDA d.d.	1.540.000,00	104,67	Tržišna cijena	10.320.642,76	1,58%
JDGL-O-20CA (HRJDGLO20CA4) JADRAN-GALENSKI LABORATORIJ d.d.	7.526.833,00	106,58	Interni model vrednovanja	8.032.698,68	1,23%
ZGHO-O-237A (HRZGHO0237A3) ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o.	6.562.710,00	101,67	Interni model vrednovanja	6.916.213,88	1,06%
HP-O-19BA (HRHP00O19BA4) HRVATSKA POŠTA d.d.	5.837.725,00	104,21	Interni model vrednovanja	6.125.014,52	0,94%
Dugoročne obveznice drugih država-OTHER(FVPL)				18.042.727,34	2,77%
ROM 2,375%27EUR (XS1599193403) RUMUNJSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.000.000,00	100,22	Tržišna cijena	14.860.917,33	2,28%
BTPS 2,45%33EUR (IT0005240350) REPUBLIKA ITALIJA MINISTARSTVO FINANCIJA	456.000,00	93,75	Tržišna cijena	3.181.810,01	0,49%
Dužnički VP za koje jamči RH, EU/OECD, HNB-OTHER(FVPL)				3.199.826,50	0,49%
CRO R&D 2020 (XS0961637542) HRVATSKA BANKA ZA OBNOVU I RAZVITAK	393.000,00	109,46	Tržišna cijena	3.199.826,50	0,49%
Ukupno (Fer vrijednost kroz račun dobiti i gubitka):				535.049.337,88	82,05%

Imovina koja se mjeri po amortiziranom trošku					
Pozicija	Količina	Cijena	Metoda vrednovanja	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Dugoročne obveznice RH-HTC(AC)				108.002.943,63	16,56%
CRO 2,7%28EUR (XS1713462668) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.150.000,00	98,31	Diskontirani novčani tok	15.615.386,03	2,39%
CRO 2,75%30EUR (XS1713475306) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.700.000,00	100,00	Diskontirani novčani tok	12.748.497,26	1,95%
CRO 6,625%20USD (XS0525827845) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.800.000,00	106,43	Diskontirani novčani tok	12.488.077,61	1,92%
CRO 5,5%23USD (XS0908769887) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.800.000,00	106,93	Diskontirani novčani tok	12.345.987,92	1,89%
CRO 6,75%19USD (XS0464257152) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.800.000,00	104,97	Diskontirani novčani tok	12.090.753,82	1,85%
CRO 3,00%27EUR (XS1428088626) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	900.000,00	103,13	Diskontirani novčani tok	6.904.921,87	1,06%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	118,62	Diskontirani novčani tok	6.038.126,94	0,93%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	117,44	Diskontirani novčani tok	5.978.904,13	0,92%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	118,30	Diskontirani novčani tok	5.924.310,96	0,91%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	118,29	Diskontirani novčani tok	5.923.994,59	0,91%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	118,20	Diskontirani novčani tok	5.919.406,12	0,91%

RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.945.000,00	118,55	Diskontirani novčani tok	4.761.234,98	0,73%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.000.000,00	118,54	Diskontirani novčani tok	1.206.748,72	0,19%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	40.000,00	117,65	Diskontirani novčani tok	47.916,30	0,01%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	7.246,00	117,60	Diskontirani novčani tok	8.676,38	0,00%
Dugoročne korporativne obveznice iz RH-HTC(AC)				10.904.444,36	1,67%
ZGHO-O-237A (HRZGHOO237A3) ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o.	10.000.000,00	105,33	Diskontirani novčani tok	10.904.444,36	1,67%
Ukupno (Imovina koja se mjeri po amortiziranom trošku):				118.907.387,99	18,23%

Izvedenice					
Pozicija	Količina	Cijena	Metoda vrednovanja	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
FX FORWARD				- 45.454,80	-0,01%
FX Fwd EUR/HRK ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	- 3.500.000,00	- 0,06	Tržišna cijena	224.241,50	0,03%
FX Fwd EUR/HRK RAIFFEISENBANK AUSTRIA d.d.	- 1.500.000,00	- 0,06	Tržišna cijena	88.690,50	0,01%
FX Fwd EUR/HRK ZAGREBAČKA BANKA d.d.	- 5.000.000,00	0,00	Tržišna cijena	6.080,00	0,00%
FX Fwd EUR/HRK RAIFFEISENBANK AUSTRIA d.d.	- 2.500.000,00	0,00	Tržišna cijena	4.057,50	0,00%
FX Fwd EUR/HRK ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	- 2.900.000,00	0,00	Tržišna cijena	1.226,70	0,00%
FX Fwd EUR/HRK RAIFFEISENBANK AUSTRIA d.d.	- 2.000.000,00	0,00	Tržišna cijena	- 7.688,00	0,00%
FX Fwd USD/HRK ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	- 1.500.000,00	0,09	Tržišna cijena	- 139.638,00	-0,02%
FX Fwd USD/HRK RAIFFEISENBANK AUSTRIA d.d.	- 2.500.000,00	0,09	Tržišna cijena	- 222.425,00	-0,03%
Ukupno (Izvedenice):				- 45.454,80	-0,01%

Pozicija	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Obveze	- 2.957.645,19	-0,45%

Sveukupno (Neto imovina):	652.108.240,67	100,00%
----------------------------------	-----------------------	----------------