

Popis ulaganja obveznog mirovinskog fonda

PBZ CROATIA OSIGURANJE obvezni mirovinski fond – kategorija C

Datum: 30.6.2020.

Pozicija	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Novčana sredstva - ADDIKO BANK d.d.	15.949.365,98	1,55%
Novčana sredstva - ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	4.499,80	0,00%
Novčana sredstva - ZAGREBAČKA BANKA d.d.	6.993,89	0,00%
Potraživanja	185.461.895,29	18,06%

Fer vrijednost kroz račun dobiti i gubitka

Pozicija	Količina	Cijena	Metoda vrednovanja	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Dugoročne obveznice RH-OTHER(FVPL)				591.885.518,06	57,62%
RHMF-O-34BA (HRRHMFO34BA1) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	152.000.000,00	96,24	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	148.923.848,56	14,50%
RHMF-O-403E (HRRHMFO403E6) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	11.000.000,00	97,44	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	81.354.524,99	7,92%
CRO 1,5%31EUR (XS2190201983) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	6.880.000,00	99,97	Tržišna cijena	52.018.409,92	5,06%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	35.072.816,30	118,26	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	42.226.175,41	4,11%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	32.402.750,00	121,19	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	39.328.446,50	3,83%
CRO 3,875%22EUR (XS1028953989) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.950.000,00	106,50	Tržišna cijena	31.895.723,82	3,11%
CRO 3,00%25EUR (XS1117298916) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.594.000,00	110,23	Tržišna cijena	30.192.002,30	2,94%
RHMF-O-275E (HRRHMFO275E8) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	4.050.000,00	98,16	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	30.084.562,62	2,93%
CRO 2,75%30EUR (XS1713475306) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.260.000,00	112,65	Tržišna cijena	28.045.416,89	2,73%
CRO 1,125%29EUR (XS1843434876) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.614.000,00	99,40	Tržišna cijena	27.161.831,88	2,64%
CRO 2,7%28EUR (XS1713462668) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.150.000,00	111,59	Tržišna cijena	18.153.035,23	1,77%
RHMF-O-282A (HRRHMFO282A2) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	15.700.000,00	114,46	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	18.148.471,93	1,77%
CRO 3,00%27EUR (XS1428088626) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.000.000,00	112,08	Tržišna cijena	17.070.586,04	1,66%
CRO 6,375%21USD (XS0607904264) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.600.000,00	103,71	Tržišna cijena	11.312.805,27	1,10%
RHMF-O-227E (HRRHMFO227E9) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	959.422,00	112,69	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	8.379.372,52	0,82%
RHMF-O-222E (HRRHMFO222E0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.000.000,00	100,22	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	7.590.304,18	0,74%

Dugoročne obveznice drugih država-OTHER(FVPL)				52.828.811,81	5,14%
FRTR 2,5%30EUR (FR0011883966) REPUBLIKA FRANCUSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.200.000,00	126,70	Tržišna cijena	30.705.388,22	2,99%
HUN 1,75%35EUR (XS2181689659) MAĐARSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.965.000,00	98,59	Cijena objavljena na službenom financijsko- informativskom servisu	22.123.423,59	2,15%
Dugoročne korporativne obveznice iz RH-OTHER(FVPL)				33.259.690,15	3,24%
HEP 2022 USD (XS1309493630) HRVATSKA ELEKTROPRIVREDA d.d.	3.040.000,00	107,78	Tržišna cijena	22.200.354,36	2,16%
ZGHO-O-237A (HRZGHOO237A3) ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o.	6.562.710,00	106,91	Interni model vrednovanja	7.259.820,00	0,71%
JDGL-O-20CA (HRJDGLO20CA4) JADRAN-GALENSKI LABORATORIJ d.d.	3.735.000,00	101,58	Interni model vrednovanja	3.799.515,79	0,37%
Udjeli u UCITS fondovima iz RH-OTHER(FVPL)				25.004.033,47	2,43%
OTPI-U-STBL (HROTPUUSTBL5) OTP INVEST d.o.o.	25,00	1.000.161,3 4	Tržišna cijena	25.004.033,47	2,43%
Ukupno (Fer vrijednost kroz račun dobiti i gubitka):				702.978.053,49	68,44%

Imovina koja se mjeri po amortiziranom trošku					
Pozicija	Količina	Cijena	Metoda vrednovanja	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Dugoročne obveznice RH-HTC(AC)				247.396.342,34	24,09%
RHMF-O-403E (HRRHMFO403E6) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	11.000.000,00	99,48	Diskontirani novčani tok	83.051.205,02	8,09%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	23.000.000,00	99,72	Diskontirani novčani tok	23.195.485,76	2,26%
CRO 2,7%28EUR (XS1713462668) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.150.000,00	98,65	Diskontirani novčani tok	16.049.511,35	1,56%
CRO 2,75%30EUR (XS1713475306) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.700.000,00	100,00	Diskontirani novčani tok	12.999.643,86	1,27%
CRO 5,5%23USD (XS0908769887) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.800.000,00	103,96	Diskontirani novčani tok	12.710.423,37	1,24%
CRO 6,625%20USD (XS0525827845) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.800.000,00	100,12	Diskontirani novčani tok	12.456.708,20	1,21%
RHMF-O-23BA (HRRHMFO23BA4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	10.000.000,00	102,06	Diskontirani novčani tok	10.222.065,16	1,00%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	10.000.000,00	99,68	Diskontirani novčani tok	10.081.224,23	0,98%
CRO 3,00%27EUR (XS1428088626) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	900.000,00	102,40	Diskontirani novčani tok	7.023.244,23	0,68%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	112,99	Diskontirani novčani tok	5.756.481,40	0,56%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	112,18	Diskontirani novčani tok	5.716.083,61	0,56%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	113,69	Diskontirani novčani tok	5.693.686,41	0,55%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	113,68	Diskontirani novčani tok	5.693.454,32	0,55%

RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	113,62	Diskontirani novčani tok	5.690.087,91	0,55%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.100.000,00	99,68	Diskontirani novčani tok	5.141.482,68	0,50%
RHMF-O-23BA (HRRHMFO23BA4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	102,06	Diskontirani novčani tok	5.110.975,59	0,50%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	100,46	Diskontirani novčani tok	5.079.307,96	0,49%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	99,69	Diskontirani novčani tok	5.040.689,61	0,49%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	4.900.000,00	99,69	Diskontirani novčani tok	4.939.879,80	0,48%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.945.000,00	112,94	Diskontirani novčani tok	4.539.924,28	0,44%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.000.000,00	112,93	Diskontirani novčani tok	1.150.699,06	0,11%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	40.000,00	112,33	Diskontirani novčani tok	45.786,76	0,00%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	7.246,00	112,29	Diskontirani novčani tok	8.291,77	0,00%
Dužnički vp javnog međunarodnog tijela većine čl.EU- HTC(AC)				13.068.350,52	1,27%
EBRD 0,97%23HRK (XS1921398720) EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION AND DEVELOPMENT	13.000.000,00	100,00	Diskontirani novčani tok	13.068.350,52	1,27%
Dugoročne korporativne obveznice iz RH-HTC(AC)				10.689.586,07	1,04%
ZGHO-O-237A (HRZGHO0237A3) ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o.	10.000.000,00	103,18	Diskontirani novčani tok	10.689.586,07	1,04%
Ukupno (Imovina koja se mjeri po amortiziranom trošku):				271.154.278,93	26,40%

Izvedenice					
Pozicija	Količina	Cijena	Metoda vrednovanja	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Izvedenice-FX SWAP-short				317.720,20	0,03%
FX SWAP EUR/HRK RAIFFEISENBANK AUSTRIA d.d.	- 7.500.000,00	- 0,01	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	111.315,00	0,01%
FX SWAP EUR/HRK ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	- 10.000.000,00	- 0,01	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	110.020,00	0,01%
FX SWAP USD/HRK ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	- 3.200.000,00	- 0,03	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	81.427,20	0,01%
FX SWAP EUR/HRK ZAGREBAČKA BANKA d.d.	- 7.000.000,00	0,00	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	10.990,00	0,00%
FX SWAP EUR/HRK ZAGREBAČKA BANKA d.d.	- 3.200.000,00	0,00	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	3.968,00	0,00%
FX FORWARD				- 1.081.603,00	-0,11%
FX Fwd EUR/HRK ZAGREBAČKA BANKA d.d.	- 2.500.000,00	0,11	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	- 279.325,00	-0,03%

FX Fwd EUR/HRK ZAGREBAČKA BANKA d.d.	- 3.000.000,00	0,12	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	- 353.958,00	-0,03%
FX Fwd EUR/HRK ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	- 4.000.000,00	0,11	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	- 448.320,00	-0,04%
Ukupno (Izvedenice):				- 763.882,80	-0,07%

Pozicija	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Obveze	- 147.654.064,73	-14,38%

Sveukupno (Neto imovina):	1.027.137.139,85	100,00%
----------------------------------	-------------------------	----------------