

**Popis ulaganja obveznog mirovinskog fonda**

PBZ CROATIA OSIGURANJE obvezni mirovinski fond – kategorija C

Datum: 31.12.2020.

Pozicija	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Novčana sredstva - ADDIKO BANK d.d.	12.672.660,93	1,08%
Novčana sredstva - ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	21.004.498,41	1,79%
Novčana sredstva - ZAGREBAČKA BANKA d.d.	21.006.009,00	1,79%

**Fer vrijednost kroz račun dobiti i gubitka**

Pozicija	Količina	Cijena	Metoda vrednovanja	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Dugoročne obveznice RH-OTHER(FVPL)				<b>534.515.013,05</b>	<b>45,57%</b>
RHMF-O-34BA (HRRHMFO34BA1) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	92.000.000,00	98,14	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	91.645.191,75	7,81%
CRO 1,5%31EUR (XS2190201983) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	6.880.000,00	109,70	Tržišna cijena	57.301.930,05	4,89%
RHMF-O-282A (HRRHMFO282A2) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	42.700.000,00	116,35	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	50.168.069,88	4,28%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	35.072.816,30	118,82	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	42.423.007,35	3,62%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	32.402.750,00	122,80	Tržišna cijena	39.854.892,90	3,40%
RHMF-O-403E (HRRHMFO403E6) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	97,68	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	36.966.190,31	3,15%
CRO 3,875%22EUR (XS1028953989) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.950.000,00	106,04	Tržišna cijena	32.246.939,17	2,75%
CRO 3,00%25EUR (XS1117298916) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.594.000,00	112,25	Tržišna cijena	31.061.542,11	2,65%
RHMF-O-275E (HRRHMFO275E8) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	4.050.000,00	101,16	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	30.914.545,99	2,64%
CRO 2,75%30EUR (XS1713475306) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.260.000,00	119,81	Tržišna cijena	30.062.516,10	2,56%
CRO 1,125%29EUR (XS1843434876) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.614.000,00	105,35	Tržišna cijena	28.860.400,54	2,46%
CRO 2,7%28EUR (XS1713462668) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.150.000,00	116,70	Tržišna cijena	19.148.504,44	1,63%
CRO 3,00%27EUR (XS1428088626) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.000.000,00	116,74	Tržišna cijena	17.951.336,17	1,53%
CRO 6,375%21USD (XS0607904264) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.600.000,00	101,44	Tržišna cijena	10.131.182,39	0,86%
RHMF-O-227E (HRRHMFO227E9) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	959.422,00	110,30	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	8.182.920,80	0,70%
RHMF-O-222E (HRRHMFO222E0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.000.000,00	100,58	Cijena objavljena na službenom financijsko-informacijskom servisu	7.595.843,10	0,65%

Dugoročne obveznice drugih država-OTHER(FVPL)				97.390.258,74	8,30%
BTPS 2,1%26EUR (IT0005370306) REPUBLIKA ITALIJA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.000.000,00	111,44	Tržišna cijena	25.414.963,24	2,17%
HUN 1,75%35EUR (XS2181689659) MAĐARSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.965.000,00	110,95	Tržišna cijena	25.016.699,23	2,13%
ROM 3,624%30EUR (XS2178857954) RUMUNJSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.600.000,00	119,61	Tržišna cijena	23.864.203,75	2,03%
ROM 1.375%29EUR (XS2262211076) RUMUNJSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.000.000,00	102,03	Tržišna cijena	23.094.392,52	1,97%
Dugoročne korporativne obveznice iz RH-OTHER(FVPL)				42.030.790,11	3,58%
HEP 2022 USD (XS1309493630) HRVATSKA ELEKTROPRIVREDA d.d.	3.040.000,00	108,92	Tržišna cijena	20.531.447,71	1,75%
ATGR-O-25CA (HRATGRO25CA5) ATLANTIC GRUPA d.d.	15.000.000,00	97,16	Interni model vrednovanja	14.581.361,54	1,24%
ZGHO-O-237A (HRZGHO0237A3) ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o.	6.562.710,00	103,62	Interni model vrednovanja	6.917.980,86	0,59%
Udjeli u UCITS fondovima iz RH-OTHER(FVPL)				25.433.322,36	2,17%
OTPI-U-STBL (HROTPIUSTBL5) OTP INVEST d.o.o.	25,00	1.017.332,8 9	Tržišna cijena	25.433.322,36	2,17%
Dugoročne obveznice lokalne i reg. samoupr.-OTHER(FVPL)				11.656.405,91	0,99%
MADRI 0,4%30EUR (ES0000101933) AUTONOMNA REGIJA MADRID	1.500.000,00	102,82	Tržišna cijena	11.656.405,91	0,99%
<b>Ukupno (Fer vrijednost kroz račun dobiti i gubitka):</b>				<b>711.025.790,17</b>	<b>60,62%</b>

Imovina koja se mjeri po amortiziranom trošku					
pozicija	Količina	Cijena	Metoda vrednovanja	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Dugoročne obveznice RH-HTC(AC)				294.593.397,67	25,12%
RHMF-O-403E (HRRHMFO403E6) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	11.000.000,00	99,49	Diskontirani novčani tok	82.826.915,73	7,06%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	51.000.000,00	119,50	Diskontirani novčani tok	61.046.926,74	5,21%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	23.000.000,00	99,74	Diskontirani novčani tok	23.199.208,09	1,98%
CRO 2,7%28EUR (XS1713462668) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	2.150.000,00	98,73	Diskontirani novčani tok	16.237.320,30	1,38%
CRO 2,75%30EUR (XS1713475306) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.700.000,00	100,00	Diskontirani novčani tok	13.139.083,55	1,12%
CRO 5,5%23USD (XS0908769887) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.800.000,00	103,23	Diskontirani novčani tok	11.551.862,10	0,98%
RHMF-O-23BA (HRRHMFO23BA4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	10.000.000,00	101,75	Diskontirani novčani tok	10.191.638,54	0,87%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	10.000.000,00	99,70	Diskontirani novčani tok	10.083.052,48	0,86%
CRO 3,00%27EUR (XS1428088626) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	900.000,00	102,22	Diskontirani novčani tok	7.093.120,55	0,60%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	111,62	Diskontirani novčani tok	5.687.773,96	0,48%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	110,90	Diskontirani novčani tok	5.651.856,47	0,48%

RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	112,56	Diskontirani novčani tok	5.637.701,29	0,48%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	112,55	Diskontirani novčani tok	5.637.489,44	0,48%
RHMF-O-26CA (HRRHMFO26CA5) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	112,49	Diskontirani novčani tok	5.634.416,56	0,48%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.100.000,00	99,70	Diskontirani novčani tok	5.142.411,83	0,44%
RHMF-O-23BA (HRRHMFO23BA4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	101,75	Diskontirani novčani tok	5.095.770,85	0,43%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	100,43	Diskontirani novčani tok	5.078.060,46	0,43%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	5.000.000,00	99,70	Diskontirani novčani tok	5.041.599,43	0,43%
RHMF-O-297A (HRRHMFO297A0) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	4.900.000,00	99,70	Diskontirani novčani tok	4.940.771,19	0,42%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	3.945.000,00	111,57	Diskontirani novčani tok	4.485.929,79	0,38%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	1.000.000,00	111,56	Diskontirani novčani tok	1.137.023,99	0,10%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	40.000,00	111,03	Diskontirani novčani tok	45.266,52	0,00%
RHMF-O-257A (HRRHMFO257A4) REPUBLIKA HRVATSKA MINISTARSTVO FINANCIJA	7.246,00	111,00	Diskontirani novčani tok	8.197,81	0,00%
<b>Kratkoročni domaći bankovni depoziti-HTC(AC)</b>				<b>90.000.155,87</b>	<b>7,67%</b>
DEPOZIT HRK ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	1,00	35.000.000,00	Diskontirani novčani tok	35.000.148,22	2,98%
DEPOZIT HRK ZAGREBAČKA BANKA d.d.	1,00	35.000.000,00	Diskontirani novčani tok	35.000.007,65	2,98%
DEPOZIT HRK RAIFFEISENBANK AUSTRIA d.d.	1,00	20.000.000,00	Diskontirani novčani tok	20.000.000,00	1,71%
<b>Dužnički vp javnog međunarodnog tijela većine čl.EU- HTC(AC)</b>				<b>13.005.854,99</b>	<b>1,11%</b>
EBRD 0,97%23HRK (XS1921398720) EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION AND DEVELOPMENT	13.000.000,00	100,00	Diskontirani novčani tok	13.005.854,99	1,11%
<b>Dugoročne korporativne obveznice iz RH-HTC(AC)</b>				<b>10.443.986,38</b>	<b>0,89%</b>
ZGHO-O-237A (HRZGHO0237A3) ZAGREBAČKI HOLDING d.o.o.	10.000.000,00	102,65	Diskontirani novčani tok	10.443.986,38	0,89%
<b>Ukupno (Imovina koja se mjeri po amortiziranom trošku):</b>				<b>408.043.394,91</b>	<b>34,79%</b>

<b>Izvedenice</b>					
<b>Pozicija</b>	<b>Količina</b>	<b>Cijena</b>	<b>Metoda vrednovanja</b>	<b>Vrijednost (HRK)</b>	<b>Udio u NAV-u</b>
<b>Izvedenice-FX SWAP-short</b>				<b>404.470,40</b>	<b>0,03%</b>
FX SWAP USD/HRK ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	- 3.200.000,00	- 0,07	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	232.201,60	0,02%
FX SWAP EUR/HRK ZAGREBAČKA BANKA d.d.	- 7.700.000,00	- 0,02	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	160.529,60	0,01%

FX SWAP USD/HRK RAIFFEISENBANK AUSTRIA d.d.	- 1.700.000,00	- 0,06	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	107.407,70	0,01%
FX SWAP EUR/HRK ERSTE & STEIERMERKISCHE BANK d.d.	- 14.000.000,00	0,00	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	23.604,00	0,00%
FX SWAP EUR/HRK RAIFFEISENBANK AUSTRIA d.d.	- 15.500.000,00	0,01	Cijena izračunata upotrebom tržišnih parametara	- 119.272,50	-0,01%
<b>Ukupno (Izvedenice):</b>				<b>404.470,40</b>	<b>0,03%</b>

Pozicija	Vrijednost (HRK)	Udio u NAV-u
Obveze	- 1.327.613,47	-0,11%

<b>Sveukupno (Neto imovina):</b>	<b>1.172.829.210,35</b>	<b>100,00%</b>
----------------------------------	-------------------------	----------------