



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен доброволен пензиски фонд НЛБ Пензија Плус

За првите три месеци од 2017 година



NLB

Нов пензиски фонд

Содржина

1. Извештај за нето средствата на ОДПФ НЛБ Пензија Плус на ден 31.03.2017	3
2. Извештај за работењето на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01.-31.03.2017	4
3. Извештај за промените на нето средствата на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01.-31.03.2017	5
4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01.-31.03.2017	6
5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01-31.03.2017	7
6. Извештаи за структурата на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус на ден 31.03.2017	8
7. Структура на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус по видови на финансиски средства на ден 31.03.2017	19
8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 31.03.2017	20
9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 31.03.2017	21

1. Извештај за нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија Плус на ден 31.03.2017

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	31.03.2016 (во 000 ден.)	31.03.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
1	10	Парични средства	3	2.684	3.531
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		488	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		15	20
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ		0	0
5	14	Побарувања од други пензиски фондови		4	0
6	15	Побарувања за дадени аванси		0	0
7	16	Побарувања од пензиските друштва или чуварот на имот		0	0
8	17	Побарувања од државата и други институции		0	0
9	18	Побарувања за хартии од вредност купени директно од издавачот		0	0
10	19	Платени трошоци за идните периоди и недостасана наплата на приходи (ABP)		0	0
11		Вложувања во хартии од вредност и депозити (12+13+14)	4	351.158	489.171
12	3	Финансиски средства кои се чуваат за тргување		148.138	183.004
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		162.580	189.839
14	5	Финансиски средства кои се чуваат до достасување		40.440	116.328
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		354.349	492.722
16	20	Обврски за неконвертирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		31	0
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		0	226
19	23	Обврски за пренос на средства на други пензиски фондови по основ на промена на членство		0	0
20	24	Краткорочни обврски за заеми и кредити		0	0
21	25	Долгорочни обврски за заеми и кредити		0	0
22	26	Обврски кон пензиското друштво	5	375	499
23	27	Обврски за брокерски и посреднички провизии		1	0
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		19	14
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		426	739
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		353.923	491.983
28		Број на издадени сметководствени единици		2.431.156,551491	3.095.355,805624
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		145,578197	158,942154
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		325.357	437.238
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		431	1.406
32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-15.188	-27.209
33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-409	-598
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		-4.204	12.158
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		47.348	68.737
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	6	588	251
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		353.923	491.983

2. Извештај за работењето на ОДФП НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01.-31.03.2017

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	31.03.2016 (во 000 ден.)	31.03.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
		ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА			
1	70	Приходи од камати и Амортизација на премијата/дисконтот на хартиите од вредност кои достасуваат на фиксен датум	7	1.903	2.653
2	71	Приходи од дивиденди	8	234	503
3	73	Реализирани капитални добивки	9	59	932
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		319	189
5	75	Други неспоменати приходи		0	0
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		2.515	4.277
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	10	1.022	1.431
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	11	0	16
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		262	289
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	12	16	32
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		0	0
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		1.300	1.768
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		1.215	2.509
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	13	-5.684	8.980
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		265	669
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		-5.419	9.649
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		-4.204	12.158

**3. Извештај за промените на нето средствата на ОДФФ НЛБ Пензија
Плус за периодот 01.01.-31.03.2017**

Ознака на позиција	Група на сметки	ПОЗИЦИЈА	31.03.2016 (во 000 ден.)	31.03.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5
		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
1	Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	1.215	2.509
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	-5.419	9.649
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	-163	993
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	-4.367	13.151
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	21.094	25.185
6	91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	430	353
7	92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-1.387	-5.731
8	93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	0	-50
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	20.137	19.757
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	15.770	32.908
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	338.153	459.075
12		На крајот на периодот (10+11)	353.923	491.983
		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	145.796,407054	159.849,525221
14		Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	2.957,517618	2.239,418582
15		Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-9.605,774474	-36.279,034004
16		Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	0,000000	-314,374016
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	139.148,150198	125.495,535783

4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01.-31.03.2017

Ознака на позиција	ПОЗИЦИЈА	31.03.2016 (во 000 ден.)	31.03.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4
	Вредноста на нето средствата на пензискиот фонд по сметководствена единица на почетокот на периодот		
1	Нето средства на пензискиот фонд на почетокот на периодот	338.153	459.075
2	Број на сметководствени единици на почетокот на периодот	2.292.008,401293	2.969.860,269841
3	Вредност на сметководствената единица на почетокот на периодот (1/2)	147,535595	154,578083
	Вредноста на нето средствата на пензискиот фонд по сметководствена единица на крајот на периодот		
4	Нето средства на пензискиот фонд на крајот на периодот	353.923	491.983
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	2.431.156,551491	3.095.355,805624
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	145,578197	158,942154
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,003005	0,003026
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,003518	0,005190
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	5,68%	6,08%

¹ Показателот се добива кога збирот од позициите 7 и 11 од Образецот бр. 2 ќе се подели со просечните нето средства на пензискиот фонд.

² Просечните нето средства на пензискиот фонд се добиваат кога збирот на вредностите на нето средствата на пензискиот фонд од последниот пресметковен ден од месеците во периодот кој е предмет на анализа ќе се подели со бројот на месеците

³ Показателот се добива кога позицијата 15 од образецот бр.2 ќе се подели со просечните нето средства на пензискиот фонд.

⁴ Се пресметува согласно формулата од Правилникот за проценка на средствата на задолжителните и доброволните пензиски фондови

Реалната стапка на принос за периодот 31.03.2010 - 31.03.2017 сведена на годишно ниво изнесува 4,65%, додека за периодот 31.12.2009-31.03.2016 изнесува 3,90%.

5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОДФФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01-31.03.2017

реден број	ПОЗИЦИЈА	Број на сметководствени единици	Извори на средствата на фондот
1	2	3	4
1	На почетокот на периодот	2.969.860,269841	391.079
2	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	159.849,525221	25.185
3	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство во текот на периодот	2.239,418582	353
4	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-36.279,034004	-5.731
5	Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-314,374016	-50
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	3.095.355,805624	410.836
Вредност на сметководствената единица			
	На почетокот на периодот		154,578083
	На крајот на периодот		158,942154

6. Извештаи за структурата на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус на ден 31.03.2017

(1) Акции							
ОПИС	Бр. на акции	Трошок на набавка по акција (во ден.)	Вкупен трошок на набавка (во ден.)	Вредност на акцијата на денот на известување	Вкупна вредност на денот на известување (во денари)	% на издавачот	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4	5	6	7	8
Обични акции			59.534.247		63.292.860		12,85%
МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.232	5.387	6.636.956	5.713	7.038.933	0,09%	1,43%
МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	16	42.000	672.000	42.001	672.016	0,09%	0,14%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.443	580	8.376.940	680	9.821.240	0,47%	1,99%
МКМТSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	22.655	260	5.897.459	250	5.657.407	0,02%	1,15%
МКМTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.641	3.699	9.768.436	3.520	9.296.320	0,58%	1,89%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.200	3.812	4.574.400	4.900	5.880.000	0,27%	1,19%
МКRPIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	268	34.500	9.246.000	40.000	10.720.000	0,67%	2,18%
МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	160	43.000	6.880.000	43.585	6.973.640	0,62%	1,42%
МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	501	8.755	4.386.255	9.000	4.509.000	0,65%	0,92%
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.346	2.300	3.095.800	2.024	2.724.304	0,50%	0,55%

Приоритетни акции							
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			59.534.247		63.292.860		12,85%
Обични акции			60.142.774		62.484.053		12,68%
BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	228	6.182	1.409.481	6.348	1.447.413	0,00%	0,29%
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	644	4.242	2.732.012	4.288	2.761.253	0,00%	0,56%
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	417	4.182	1.743.953	4.432	1.848.074	0,00%	0,38%
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	611	5.456	3.333.895	5.275	3.223.297	0,00%	0,65%
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	362	7.181	2.599.524	7.921	2.867.582	0,00%	0,58%
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	218	9.653	2.104.256	10.713	2.335.466	0,00%	0,47%
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	435	5.429	2.361.791	5.733	2.493.680	0,00%	0,51%
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	229	4.728	1.082.690	5.221	1.195.503	0,00%	0,24%
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.751	1.460	2.556.758	1.496	2.620.171	0,00%	0,53%
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	220	11.153	2.453.592	12.700	2.793.932	0,00%	0,57%
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	660	3.670	2.421.993	3.852	2.542.023	0,00%	0,52%
GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	820	1.504	1.233.541	1.519	1.245.248	0,00%	0,25%
NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	180	4.325	778.552	4.401	792.113	0,00%	0,16%

US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	34	46.220	1.571.490	48.714	1.656.273	0,00%	0,34%
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	31	47.150	1.461.645	50.940	1.579.136	0,00%	0,32%
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	230	8.528	1.961.398	9.427	2.168.286	0,00%	0,44%
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	393	6.755	2.654.831	8.255	3.244.053	0,00%	0,66%
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	141	16.540	2.332.144	15.710	2.215.180	0,00%	0,45%
US09075E1001 - BIOVERATIV INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	70	2.572	180.028	3.129	219.046	0,00%	0,04%
US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	200	6.242	1.248.393	6.169	1.233.879	0,00%	0,25%
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	690	2.418	1.668.549	2.439	1.682.612	0,00%	0,34%
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	750	1.772	1.328.988	1.712	1.284.213	0,00%	0,26%
US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	300	3.155	946.453	2.828	848.270	0,00%	0,17%
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	196	7.820	1.532.783	8.437	1.653.600	0,00%	0,34%
US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	165	7.208	1.189.376	7.175	1.183.864	0,00%	0,24%
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	482	5.033	2.425.874	5.047	2.432.758	0,00%	0,49%
US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	345	4.461	1.539.162	4.872	1.680.828	0,00%	0,34%
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	690	3.624	2.500.812	3.784	2.611.141	0,00%	0,53%
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	295	6.822	2.012.427	6.909	2.038.124	0,00%	0,41%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	661	3.238	2.140.482	3.355	2.217.683	0,00%	0,45%

US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	820	3.113	2.553.014	2.801	2.296.932	0,00%	0,47%
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	648	3.214	2.082.889	3.198	2.072.420	0,00%	0,42%
Приоритетни акции			945.357		1.000.983		0,20%
US02079K1079 - ALPHABET INC -	21	45.017	945.357	47.666	1.000.983	0,00%	0,20%
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			61.088.131		63.485.036		12,88%
Вкупно вложувања во акции			120.622.378		126.777.896		25,73%

(2) Обврзници					
ОПИС	Номинална вредност	Трошок на набавка (во ден.)	Вкупна вредност на денот на известување (во ден.)	% на издавачот	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4	5	6
Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија		219.571.657	223.355.552		45,33%
МКМИНФ20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	10.000.000	9.980.055	10.044.864	8,33%	2,04%
МКМИНФ200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	76.811	4.732.503	4.784.566	4,27%	0,97%
МКМИНФ200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	21.507	1.311.311	1.334.333	0,36%	0,27%
МКМИНФ200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	47.821	2.903.314	2.950.154	0,69%	0,60%

MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	319.761	19.213.557	19.621.932	2,66%	3,98%
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	47.770	2.850.981	2.887.166	0,87%	0,59%
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	70.532	4.170.447	4.206.334	1,18%	0,85%
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	43.308	2.547.433	2.585.454	0,48%	0,52%
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	267.863	15.704.546	15.924.906	3,35%	3,23%
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	427.384	24.884.946	25.698.799	5,00%	5,22%
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	256.229	14.877.132	15.327.470	2,14%	3,11%
MKMINF20G267 - DO2012/02-0617 25.6.2017 0:0:0 - EUR	48.686	3.077.620	3.129.219	0,26%	0,64%
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	97.549	6.075.891	6.177.758	4,76%	1,25%
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	16.260	1.008.609	1.025.519	0,32%	0,21%
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	48.785	3.016.426	3.066.999	0,59%	0,62%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	65.033	4.043.000	4.102.136	0,92%	0,83%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	48.763	3.008.155	3.052.155	2,02%	0,62%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	19.460	1.197.354	1.214.868	0,39%	0,25%
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	64.846	3.957.750	4.017.058	1,40%	0,82%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	97.274	6.163.516	6.253.666	2,73%	1,27%
MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	102.137	6.995.289	7.082.939	6,67%	1,44%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	64.975	4.110.384	4.170.504	2,50%	0,85%

MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	81.066	5.115.108	5.189.924	1,18%	1,05%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	97.498	6.125.565	6.221.035	2,33%	1,26%
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	64.861	3.957.483	4.010.970	0,49%	0,81%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	81.242	5.103.001	5.164.195	2,47%	1,05%
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	64.834	4.053.640	4.102.251	2,06%	0,83%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	64.834	4.063.129	4.116.750	0,64%	0,84%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	24.313	1.481.545	1.502.764	1,17%	0,31%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	24.314	1.478.880	1.500.364	0,93%	0,30%
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	162.092	10.206.562	10.348.629	5,24%	2,10%
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	48.787	3.047.306	3.089.722	1,95%	0,63%
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	56.906	3.540.133	3.589.409	1,17%	0,73%
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	65.047	4.043.361	4.099.641	0,85%	0,83%
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	58.227	3.593.261	3.643.276	0,77%	0,74%
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	129.460	7.969.775	8.080.708	0,91%	1,64%
MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	48.459	2.980.805	3.016.201	0,43%	0,61%
MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	24.545	1.510.408	1.524.591	0,26%	0,31%
MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	32.523	2.000.540	2.011.521	0,34%	0,41%
MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	32.456	2.000.540	2.004.487	0,44%	0,41%

MKNINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	23.883	1.470.397	1.480.317	0,21%	0,30%
Обврзници издадени или гарантирани од Народна Банка на Република Македонија					
Обврзници издадени или гарантирани од банки					
Обврзници издадени од акционерски друштва, освен банки					
Вкупно инвестиции во обврзници издадени во Република Македонија		219.571.657	223.355.552		45,33%
Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки		11.360.982	11.363.610		2,31%
FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26 25.5.2026 0:0:0 - EUR	40.000	2.442.510	2.394.677	0,00%	0,49%
US912810RU43 - T 2 7/8 11/15/46 15.11.2046 0:0:0 - USD	80.000	4.460.125	4.517.103	0,00%	0,92%
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	82.000	4.458.347	4.451.830	0,00%	0,90%
Обврзници и други хартии од вредност - издадени од странски единици на локална самоуправа					
Обврзници и други должнички хартии од вредност - издадени од странски компании и банки					
Вкупно инвестиции во обврзници издадени во странство		11.360.982	11.363.610		2,31%
Вкупно инвестиции во обврзници		230.932.638	234.719.162		47,64%

(3) Други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови					
ОПИС	Номинална вредност	Трошок на набавка (во ден.)	Вкупна вредност на денот на известување (во денари)	% на издавачот	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4	5	6
Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија					
Благајнички записи издадени од Народна Банка на Република Македонија					
Сертификати за депозит и комерцијални записи издадени или гарантирани од банки					
Хартии од вредност врз основа на хипотека издадени од банки					
Комерцијални записи издадени од акционерски друштва, освен банки					
Удели во отворени инвестициони фондови					
Други ненаведени хартии од вредност					
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во инвестициони фондови во Република Македонија		0	0		0,00%
Удели во отворени инвестициони фондови		53.401.907	56.226.425		11,41%
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.069	6.597.315	7.102.239	0,00%	1,44%

US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	325	1.722.711	1.966.397	0,00%	0,40%
US4642865251 - EDGE ISHARES MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.730	7.326.613	7.667.063	0,00%	1,56%
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.500	4.189.251	4.534.967	0,02%	0,92%
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	600	927.730	1.048.401	0,00%	0,21%
US4642868065 - ISHARES INC.- MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	970	1.498.133	1.602.393	0,00%	0,33%
US4642872422 - ISHARES TR IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	200	1.366.923	1.355.003	0,00%	0,28%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	557	3.569.723	3.976.593	0,01%	0,81%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.180	2.858.967	2.613.084	0,00%	0,53%
US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.110	1.173.067	1.376.366	0,01%	0,28%

US46434G8226 - iShares MSCI Japan ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.222	9.182.051	9.534.377	0,00%	1,94%
US46434G8309 - iShares MSCI Italy Capped ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	535	755.456	791.265	0,00%	0,16%
US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	600	797.965	786.387	0,00%	0,16%
US9229083632 - Vanguard S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	955	11.436.001	11.871.890	0,00%	2,41%
Трезорски записи издадени од странски влади					
Благајнички записи издадени од странски централни банки					
Комерцијални записи издадени од странски компании и банки					
Други ненаведени хартии од вредност					
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во инвестициони фондови издадени во странство		53.401.907	56.226.425		11,41%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		53.401.907	56.226.425		11,41%

(4) Пласмани и депозити			
ОПИС	Трошок за набавка (во денари)	Вкупна вредност на денот на извештајот (во денари)	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4
Краткорочни депозити	15.465.167	15.471.925	3,14%
Долгорочни депозити	55.400.000	55.975.773	11,36%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	70.865.167	71.447.698	14,50%

7. Структура на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус по видови на финансиски средства на ден 31.03.2017

ОПИС	Вкупна вредност на денот на известувањето (во денари)	Процентуален удел во вредноста на пензискиот фонд
Акции	126.777.896	25,73%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	234.719.162	47,64%
Краткорочни хартии од вредност	0	0,00%
Акции и удели во инвестициони фондови	56.226.425	11,41%
Парични средства	3.530.912	0,72%
Пласмани и депозити	71.447.698	14,50%
Останати средства	20.047	0,00%
Вкупно средства	492.722.141	100,00%

8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОДФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 31.03.2017

Датум на продажба	Продадена хартија од вредност	Бр. на хартии од вредност	Сметководствена вредност	Продажна цена	Реализирана добивка или загуба
1	2	3	4	5	6 (5-4)
	Обични акции издадени во Република Македонија	300	1.616.142	1.709.650	93.508
21.3.2017	MKALKA101011 - ALK	90	484.843	512.550	27.707
21.3.2017	MKALKA101011 - ALK	100	538.714	570.100	31.386
23.3.2017	MKALKA101011 - ALK	110	592.585	627.000	34.415
	Обични акции издадени од странски компании и банки	1.020	5.116.885	5.331.265	214.380
16.3.2017	BE0974293251 - ABI	100	618.193	632.038	13.844
16.3.2017	CH0038863350 - NESN	100	418.214	440.863	22.649
18.1.2017	DE0008404005 - ALV	30	289.576	292.873	3.296
18.1.2017	DE000BASF111 - BAS	50	271.470	273.040	1.570
16.3.2017	FR0000120578 - SAN	200	945.581	1.016.857	71.276
18.1.2017	FR0000121014 - MC	50	557.634	574.215	16.581
20.1.2017	FR0000131104 - BNP	80	297.815	295.968	-1.847
24.2.2017	US0378331005 - AAPL	40	270.212	316.520	46.308
16.3.2017	US5184391044 - EL	110	490.747	543.338	52.590
20.1.2017	US6934751057 - PNC	40	272.871	268.543	-4.328
24.2.2017	US9182041080 - VFC	220	684.570	677.011	-7.559
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	73.500	4.335.702	4.441.606	105.904
29.3.2017	MKMINF200DF7 - RMDEN15	73.500	4.335.702	4.441.606	105.904
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	5.026	10.577.100	11.079.724	502.624
17.1.2017	US4642867075 - EWQ	220	316.557	321.807	5.250
18.1.2017	US4642867075 - EWQ	220	316.557	316.699	141
17.1.2017	US4642868065 - EWG	520	803.123	820.242	17.119
18.1.2017	US4642868065 - EWG	520	803.123	813.056	9.933

16.3.2017	US78463X8487 - CWI	3.366	6.182.263	6.646.554	464.291
17.1.2017	US9229083632 - VOO	90	1.077.738	1.085.838	8.099
18.1.2017	US9229083632 - VOO	90	1.077.738	1.075.528	-2.210
	ВКУПНО РЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ				916.416

Забелешка: Не е дозволено сумарно прикажување по финансиски инструмент, односно се евидентира секоја трансакција

9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОДФП НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 31.03.2017

Датум на последна проценка	ХАРТИЈА ОД ВРЕДНОСТ	Трошок за набавка (во денари)	Објективна вредност	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	Нереализирана добивка или загуба	Нето курсни разлики	Амортизација на дисконтот (премијата) на инструментите кои постојат на	Загуба поради оштетување
1	2	3	4	5	6	7	8	9
	Обични акции издадени во Република Македонија	59.534.247	63.292.860	0	3.758.613	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.636.956	7.038.933	0	401.977	0	0	0
	МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	672.000	672.016	0	16	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.376.940	9.821.240	0	1.444.300	0	0	0
	МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	5.897.459	5.657.407	0	-240.052	0	0	0

МКМТУR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.768.436	9.296.320	0	-472.116	0	0	0
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	4.574.400	5.880.000	0	1.305.600	0	0	0
МКРРIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.246.000	10.720.000	0	1.474.000	0	0	0
МКРЕPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.880.000	6.973.640	0	93.640	0	0	0
МКВИТА101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	4.386.255	4.509.000	0	122.745	0	0	0
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.095.800	2.724.304	0	-371.496	0	0	0
Обични акции издадени од странски компани и банки	60.142.774	62.484.053	0	2.341.279	0	0	0
BE0974293251 - ANHEUSER- BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.409.481	1.447.413	0	37.932	0	0	0
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.732.012	2.761.253	0	29.241	0	0	0
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.743.953	1.848.074	0	104.121	0	0	0
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.333.895	3.223.297	0	-110.598	0	0	0
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.599.524	2.867.582	0	268.058	0	0	0
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.104.256	2.335.466	0	231.210	0	0	0
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.361.791	2.493.680	0	131.889	0	0	0
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.082.690	1.195.503	0	112.813	0	0	0

FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.556.758	2.620.171	0	63.413	0	0	0
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.453.592	2.793.932	0	340.340	0	0	0
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.421.993	2.542.023	0	120.030	0	0	0
GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.233.541	1.245.248	0	11.707	0	0	0
NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	778.552	792.113	0	13.561	0	0	0
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.571.490	1.656.273	0	84.783	0	0	0
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.461.645	1.579.136	0	117.492	0	0	0
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.961.398	2.168.286	0	206.889	0	0	0
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.654.831	3.244.053	0	589.223	0	0	0
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.332.144	2.215.180	0	-116.965	0	0	0
US09075E1001 - BIOVERATIV INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	180.028	219.046	0	39.018	0	0	0
US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.248.393	1.233.879	0	-14.514	0	0	0
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.668.549	1.682.612	0	14.063	0	0	0
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.328.988	1.284.213	0	-44.775	0	0	0
US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	946.453	848.270	0	-98.183	0	0	0
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.532.783	1.653.600	0	120.817	0	0	0

US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.189.376	1.183.864	0	-5.513	0	0	0
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.425.874	2.432.758	0	6.884	0	0	0
US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.539.162	1.680.828	0	141.666	0	0	0
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.500.812	2.611.141	0	110.329	0	0	0
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.012.427	2.038.124	0	25.697	0	0	0
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.140.482	2.217.683	0	77.201	0	0	0
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.553.014	2.296.932	0	-256.082	0	0	0
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.082.889	2.072.420	0	-10.469	0	0	0
Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	945.357	1.000.983	0	55.626	0	0	0
US02079K1079 - ALPHABET INC -	945.357	1.000.983	0	55.626	0	0	0
Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	219.571.657	223.355.552	960.622	0	728.014	2.095.260	0
МКМИНФ20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	9.980.055	10.044.864	0	0	0	64.809	0
МКМИНФ200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	4.732.503	4.784.566	-8.393	0	16.504	43.952	0
МКМИНФ200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	1.311.311	1.334.333	6.606	0	4.584	11.830	0
МКМИНФ200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	2.903.314	2.950.154	9.249	0	10.073	27.517	0

MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	19.213.557	19.621.932	154.402	0	66.758	187.216	0
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	2.850.981	2.887.166	-2.617	0	9.842	28.960	0
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	4.170.447	4.206.334	-15.200	0	14.629	36.457	0
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	2.547.433	2.585.454	4.190	0	8.786	25.045	0
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	15.704.546	15.924.906	44.618	0	53.164	122.578	0
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	24.884.946	25.698.799	520.035	0	86.884	206.934	0
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	14.877.132	15.327.470	247.731	0	59.492	143.116	0
MKMINF20G267 - DO2012/02-0617 25.6.2017 0:0:0 - EUR	3.077.620	3.129.219	0	0	10.736	40.863	0
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	6.075.891	6.177.758	0	0	21.195	80.671	0
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	1.008.609	1.025.519	0	0	3.518	13.392	0
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	3.016.426	3.066.999	0	0	10.523	40.050	0
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	4.043.000	4.102.136	0	0	14.085	45.051	0
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	3.008.155	3.052.155	0	0	10.480	33.519	0
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.197.354	1.214.868	0	0	4.171	13.342	0
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	3.957.750	4.017.058	0	0	13.887	45.421	0
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	6.163.516	6.253.666	0	0	21.472	68.678	0
MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	6.995.289	7.082.939	0	0	24.338	63.312	0
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	4.110.384	4.170.504	0	0	14.320	45.800	0

MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	5.115.108	5.189.924	0	0	17.820	56.996	0
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	6.125.565	6.221.035	0	0	21.353	74.117	0
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	3.957.483	4.010.970	0	0	13.811	39.676	0
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	5.103.001	5.164.195	0	0	17.749	43.446	0
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	4.053.640	4.102.251	0	0	14.099	34.512	0
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	4.063.129	4.116.750	0	0	14.143	39.479	0
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.481.545	1.502.764	0	0	5.189	16.030	0
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	1.478.880	1.500.364	0	0	5.375	16.108	0
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	10.206.562	10.348.629	0	0	35.542	106.525	0
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	3.047.306	3.089.722	0	0	10.612	31.805	0
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	3.540.133	3.589.409	0	0	12.328	36.948	0
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	4.043.361	4.099.641	0	0	14.080	42.200	0
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	3.593.261	3.643.276	0	0	12.513	37.503	0
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	7.969.775	8.080.708	0	0	27.753	83.180	0
MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	2.980.805	3.016.201	0	0	9.688	25.708	0
MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	1.510.408	1.524.591	0	0	4.275	9.908	0
MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	2.000.540	2.011.521	0	0	6.477	4.504	0
MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	2.000.540	2.004.487	0	0	2.311	1.636	0

MKNINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	1.470.397	1.480.317	0	0	3.453	6.467	0
Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	11.360.982	11.363.610	32.270	0	-72.049	42.407	0
FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26 25.5.2026 0:0:0 - EUR	2.442.510	2.394.677	-59.420	0	8.539	3.049	0
US912810RU43 - T 2 7/8 11/15/46 15.11.2046 0:0:0 - USD	4.460.125	4.517.103	52.721	0	-15.987	20.244	0
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	4.458.347	4.451.830	38.969	0	-64.600	19.114	0
Удели во странски отворени инвестициони фондови	53.401.907	56.226.425	0	2.824.518	0	0	0
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	6.597.315	7.102.239	0	504.924	0	0	0
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.722.711	1.966.397	0	243.687	0	0	0
US4642865251 - EDGE ISHARES MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	7.326.613	7.667.063	0	340.450	0	0	0
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	4.189.251	4.534.967	0	345.717	0	0	0
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	927.730	1.048.401	0	120.670	0	0	0
US4642868065 - ISHARES INC.- MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.498.133	1.602.393	0	104.260	0	0	0

US4642872422 - ISHARES TR IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.366.923	1.355.003	0	-11.921	0	0	0
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.569.723	3.976.593	0	406.870	0	0	0
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.858.967	2.613.084	0	-245.884	0	0	0
US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.173.067	1.376.366	0	203.299	0	0	0
US46434G8226 - iShares MSCI Japan ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	9.182.051	9.534.377	0	352.326	0	0	0
US46434G8309 - iShares MSCI Italy Capped ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	755.456	791.265	0	35.809	0	0	0
US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	797.965	786.387	0	-11.579	0	0	0
US9229083632 - Vanguard S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	11.436.001	11.871.890	0	435.889	0	0	0
ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	404.956.923	417.723.483	992.892	8.980.036	655.965	2.137.667	0

Забелешка: Вкупната разлика помеѓу објективната (фер) вредност и трошокот на набавка е еднаква вкупно неререализираните добивки (загуби) од вложување во хартии од вредност зголемени за ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба, нето

курсните разлики, амортизацијата на дисконтот (премијата) на средствата кои доспеваат на фиксен датум и загубата поради оштетување, зависно од видот на средството.

* Во позицијата амортизација на дисконт е додадена пресметаната купонска камата на обврзниците со фиксен датум на доспевање.

Обелоденување поврзано со ризикот од промена на каматните стапки

	Рочност на промената на каматните стапки на средствата и обврските во денари						
	од 1 до 3 месеци	од 3 до 12 месеци	од 1-5 години	над 5 год	Некаматносни	Фиксни каматни стапки	Вкупно
Средства							
1) Пари и депозити кај банки	3.530.912	0	0	0	0	0	3.530.912
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	183.004.321	0	183.004.321
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	189.839.413	189.839.413
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	414.463	2.403.990	42.900.000	0	0	70.608.995	116.327.448
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	20.047	0	20.047
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	3.945.375	2.403.990	42.900.000	0	183.024.368	260.448.408	492.722.141
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	739.622	0	739.622
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	739.622	0	739.622
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	3.945.375	2.403.990	42.900.000	0	182.284.746	260.448.408	491.982.519

Обелоденување на ефективните каматни стапки за главните валути на средствата и обврските на пензискиот фонд

	МКД	EUR	USD	CHF	UK Pound
Средства	%	%	%	%	%
Пари и депозити кај банки	0,50	0,00	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти расположливи за продавање	2,64	3,89	2,72	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	3,22	4,14	0,01	0,01	0,00
Обврски	%	%	%	%	%
Обврски по основ на заеми и кредити					

Обелоденувања поврзани со ликвидносниот ризик

	Резидуална рочност на достасување на средствата и обврските				
	од 1 до 3 месеци	од 3 до 12 мес.	од 1 до 5 год.	над 5 год.	Вкупно
Средства					
1) Пари и депозити кај банки	3.530.912	0	0	0	3.530.912
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	183.004.321	0	0	0	183.004.321
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	189.839.413	0	0	0	189.839.413
4) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	4.445.246	12.451.272	55.400.000	44.030.929	116.327.448
5) Останати средства на пензискиот фонд	20.047	0	0	0	20.047
5) <i>Вкупни средства (1+2+3+4+5)</i>	380.839.939	12.451.272	55.400.000	44.030.929	492.722.141
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	739.622	0	0	0	739.622
8) <i>Вкупно обврски (6+7)</i>	739.622	0	0	0	739.622
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	380.100.317	12.451.272	55.400.000	44.030.929	491.982.519
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	380.100.317	392.551.589	447.951.589	491.982.519	

Обелоденувања поврзани со ризикот на девизните курсеви

	Валутна структура на средствата и обврските					
	МКД	EUR	USD	GBP	Други	Вкупно
Средства						
1) Пари и депозити кај банки	877.200	0	2.653.712	0	0	3.530.912
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	63.292.860	30.658.667	84.443.467	0	4.609.327	183.004.321
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	10.044.864	170.825.616	8.968.933	0	0	189.839.413
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	69.128.482	45.637.507	1.052.398	0	509.061	116.327.448
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	20.047	-	0	20.047
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	143.343.406	247.121.790	97.138.558	0	5.118.388	492.722.141
Обврски	733.608	0	6.014	0	0	739.622

Обелоденувања поврзани со оштетувања на финансиските инструменти (кредитен ризик)

	тековен период	предходен период			тековен период	предходен период
1) Пари и депозити кај банки				1) Состојба на финансиски инструменти кои се предмет на тестирање за оштетување почетокот на периодот		
2) Финансиски инструменти расположливи за продавање (2=2а+2б)				2) Вложувања во финансиски инструменти кои се предмет на тестирање за оштетување во текот на периодот		
2а) финансиски инструменти расположливи за продавање-должнички				3) Продажби на финансиски инструменти кои се предмет на тестирање за оштетување во текот на периодот (се презентира со негативен предзнак)		
2б) финансиски инструменти расположливи за продавање-сопственички (МСС 39 точка 103)				4) Реализирани добивки / (загуби) во текот на периодот		
3) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување				5) Нереализирани добивки/ (загуби) во текот на периодот		
4) Вкупно финансиски инструменти тестирани за оштетување (4=1+2+3)				6) Намалување / (Зголемување) на исправката на вредноста во текот на периодот		
5) Исправка на вредноста (се презентира со негативен предзнак)				7) Состојба на финансиски инструменти кои се предмет на тестирање за оштетување крајот на периодот (7=1+2+3+4+5+6)		
6) Состојба на крајот на периодот (6=4+5)						

Супервизор на капитално финансирано пензиско осигурување е Агенцијата за супервизија на капитално финансирано пензиско осигурување (МАПАС) (02) 3224 229, www.mapas.mk