



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен доброволен пензиски фонд НЛБ Пензија Плус

За првите шест месеци од 2017 година



NLB

Нов пензиски фонд

Содржина

1. Извештај за нето средствата на ОДПФ НЛБ Пензија Плус на ден 30.06.2017	3
2. Извештај за работењето на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01.-30.06.2017	5
3. Извештај за промените на нето средствата на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01.-30.06.2017	6
4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01.-30.06.2017	8
5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01-30.06.2017	9
6. Извештаи за структурата на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус на ден 30.06.2017	10
7. Структура на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус по видови на финансиски средства на ден 30.06.2017	21
8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 30.06.2017	22
9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 30.06.2017	24

1. Извештај за нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија Плус на ден 30.06.2017

реден број	Група на сметки	ПОЗИЦИЈА	Белешки	30.06.2016 (во 000 ден.)	30.06.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
1	10	Парични средства	3	7.361	3.449
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		686	1.452
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ		0	0
5	14	Побарувања од други пензиски фондови		603	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 (АВР)		0	827
11		Вложувања во хартии од вредност и депозити (12+13+14)	4	369.204	513.967
12	3	Финансиски средства кои се чуваат за тргување		145.063	202.428
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		156.540	202.921
14	5	Финансиски средства кои се чуваат до достасување		67.601	108.618
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		377.854	519.695
16	20	Обврски за неконвертирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		3.533	827
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		0	0
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	386	551
23	27	Обврски за брокерски и		13	0

		посреднички провизии			
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		7	897
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		3.939	2.275
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		373.915	517.420
28		Број на издадени сметководствени единици		2.562.506,580891	3.234.457,551163
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		145,917674	159,971128
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		346.229	462.335
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		1.036	1.493
32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-17.506	-29.390
33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-409	-1.342
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		-2.456	14.882
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		47.348	68.737
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	6	-327	705
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		373.915	517.420

2. Извештај за работењето на ОДФП НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01.-30.06.2017

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	30.06.2016 (во 000 ден.)	30.06.2017 (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	3.916	5.425
2	71	Приходи од дивиденди	8	3.217	3.863
3	73	Реализирани капитални добивки	9	79	1.116
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		881	373
5	75	Други неспоменати приходи		0	0
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		8.093	10.777
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	10	2.110	2.941
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	11	154	82
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		737	502
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	12	25	39
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		1	0
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		3.027	3.564
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		5.066	7.213
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	13	-7.789	7.537
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		267	132
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		-7.522	7.669
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		-2.456	14.882

3. Извештај за промените на нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија
Плус за периодот 01.01.-30.06.2017

Ознака на позиција	Група на сметки	ПОЗИЦИЈА	30.06.2016 (во 000 ден.)	30.06.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5
		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВА ЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
1	Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	5.066	7.213
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	-7.522	7.669
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	-1.077	1.447
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВА ЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	-3.533	16.329
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	41.966	50.281
6	91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	1.035	440
7	92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-3.705	-7.912
8	93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	0	-793
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВА ЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	39.296	42.016
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВА ЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	35.763	58.345
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	338.153	459.075
12		На крајот на периодот (10+11)	373.915	517.420
		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	288.895,747259	316.727,497929

14		Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	7.101,620246	2.788,466160
15		Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-25.499,187907	-49.929,965497
16		Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	0,000000	-4.988,717270
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	270.498,179598	264.597,281322

4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01.-30.06.2017

Ознака на позиција	ПОЗИЦИЈА	30.06.2016 (во 000 ден.)	30.06.2017 (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	373.915	517.420
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	2.562.506,580891	3.234.457,551163
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	145,917674	159,971128
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,005988	0,006013
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,014209	0,014555
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	5,49%	6,15%

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	356.540	495.555
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 30.06.2010 - 30.06.2017 сведена на годишно ниво изнесува 4,52%, додека за периодот 31.12.2009-30.06.2016 изнесува 3,70%.

**5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОДФФ НЛБ
Пензија Плус за периодот 01.01-30.06.2017**

реден број	ПОЗИЦИЈА	Број на сметководствен и единици	Извори на средствата на фондот
1	2	3	4
1	На почетокот на периодот	2.969.860,269841	391.080
2	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	316.727,497929	50.281
3	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство во текот на периодот	2.788,466160	440
4	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-49.929,965497	-7.912
5	Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-4.988,717270	-793
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	3.234.457,551163	433.096
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		154,578083
	На крајот на периодот		159,971128

6. Извештај за структурата на инвестициите на ОДФФ НЛБ Пензија Плус на ден 30.06.2017

(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							
МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.232	5.387	6.636.956	5.805	7.151.760	0,09%	1,38%
МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	16	42.000	672.000	45.000	720.000	0,09%	0,14%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.443	580	8.376.940	739	10.673.377	0,47%	2,05%
МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	22.655	260	5.897.459	241	5.459.855	0,02%	1,05%
МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.641	3.699	9.768.436	3.680	9.718.880	0,58%	1,87%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.200	3.812	4.574.400	5.100	6.120.000	0,27%	1,18%
МКRPIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	268	34.500	9.246.000	40.000	10.720.000	0,67%	2,06%
МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	160	43.000	6.880.000	44.000	7.040.000	0,62%	1,35%

МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	501	8.755	4.386.255	8.800	4.408.800	0,65%	0,85%
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.346	2.300	3.095.800	2.500	3.365.000	0,50%	0,65%
Приоритетни акции							
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			59.534.247		65.377.672		12,58%
Обични акции							
BE0974293251 - ANHEUSER- BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	228	6.182	1.409.481	5.967	1.360.550	0,00%	0,26%
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	644	4.242	2.732.012	4.503	2.899.867	0,00%	0,56%
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	417	4.182	1.743.953	4.709	1.963.594	0,00%	0,38%
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	611	5.456	3.333.895	5.015	3.064.314	0,00%	0,59%
DE0007164600 - SAP SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	110	5.688	625.637	5.643	620.704	0,00%	0,12%
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	362	7.181	2.599.524	7.426	2.688.209	0,00%	0,52%
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	258	9.773	2.521.398	10.638	2.744.513	0,00%	0,53%
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	435	5.429	2.361.791	5.004	2.176.531	0,00%	0,42%
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	229	4.728	1.082.690	5.168	1.183.533	0,00%	0,23%
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.751	1.460	2.556.758	1.478	2.587.617	0,00%	0,50%

FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	220	11.153	2.453.592	13.470	2.963.363	0,00%	0,57%
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	710	3.686	2.617.398	3.891	2.762.617	0,00%	0,53%
GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.419	1.501	2.129.695	1.434	2.034.386	0,00%	0,39%
NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	440	4.464	1.964.109	4.443	1.954.761	0,00%	0,38%
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	34	46.220	1.571.490	50.262	1.708.915	0,00%	0,33%
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	35	47.810	1.673.356	52.334	1.831.688	0,00%	0,35%
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	230	8.528	1.961.398	9.311	2.141.632	0,00%	0,41%
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	393	6.755	2.654.831	7.786	3.060.015	0,00%	0,59%
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	141	16.540	2.332.144	14.671	2.068.584	0,00%	0,40%
US09075E1001 - BIOVERATIV INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	70	2.572	180.028	3.253	227.712	0,00%	0,04%
US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	265	6.172	1.635.642	5.640	1.494.732	0,00%	0,29%
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	690	2.418	1.668.549	2.425	1.673.092	0,00%	0,32%
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.075	1.692	1.819.118	1.460	1.569.789	0,00%	0,30%
US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	300	3.155	946.453	2.309	692.722	0,00%	0,13%
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	196	7.820	1.532.783	8.293	1.625.510	0,00%	0,31%
US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	245	7.220	1.768.917	7.206	1.765.517	0,00%	0,34%

US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	642	4.959	3.183.432	4.941	3.172.411	0,00%	0,61%
US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	345	4.461	1.539.162	5.189	1.790.227	0,00%	0,34%
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	690	3.624	2.500.812	3.727	2.571.376	0,00%	0,49%
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	350	6.774	2.370.991	6.751	2.362.840	0,00%	0,45%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	661	3.238	2.140.482	3.152	2.083.784	0,00%	0,40%
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	820	3.113	2.553.014	2.414	1.979.889	0,00%	0,38%
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	778	3.166	2.462.789	2.996	2.330.644	0,00%	0,45%
Приоритетни акции							
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	21	45.017	945.357	49.130	1.031.721	0,00%	0,20%
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			67.572.680		68.187.359		13,12%
Вкупно вложувања во акции			127.106.926		133.565.031		25,70%

(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					
МКМИНФ20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	10.000.000	9.980.055	10.110.260	8,33%	1,95%
МКМИНФ200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	10.753	621.349	658.832	0,36%	0,13%
МКМИНФ200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	31.881	1.860.863	1.877.930	0,69%	0,36%
МКМИНФ200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	239.821	13.887.084	14.537.956	2,66%	2,80%
МКМИНФ200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	38.216	2.202.603	2.281.756	0,87%	0,44%
МКМИНФ200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	58.777	3.358.167	3.469.858	1,18%	0,67%
МКМИНФ200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	37.122	2.112.293	2.179.761	0,48%	0,42%
МКМИНФ200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	234.380	13.308.308	13.762.674	3,35%	2,65%
МКМИНФ200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	379.897	21.427.877	22.307.396	5,00%	4,29%
МКМИНФ200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	230.606	12.996.624	13.683.381	2,14%	2,63%
МКМИНФ20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	97.549	6.075.891	6.261.547	4,76%	1,20%
МКМИНФ20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	16.260	1.008.609	1.039.428	0,32%	0,20%

MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	48.785	3.016.426	3.108.597	0,59%	0,60%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	65.033	4.043.000	4.148.929	0,92%	0,80%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	48.763	3.008.155	3.086.971	2,02%	0,59%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	19.460	1.197.354	1.228.726	0,39%	0,24%
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	64.846	3.957.750	4.062.880	1,40%	0,78%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	97.274	5.887.861	6.046.892	2,73%	1,16%
MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	102.137	6.680.682	6.831.790	6,67%	1,31%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	64.975	3.925.984	4.032.609	2,50%	0,78%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	81.066	4.885.046	5.018.322	1,18%	0,97%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	97.498	6.125.565	6.298.010	2,33%	1,21%
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	64.861	3.957.483	4.050.944	0,49%	0,78%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	81.242	4.927.790	5.033.275	2,47%	0,97%
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	64.834	4.053.640	4.138.151	2,06%	0,80%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	64.834	4.063.129	4.157.778	0,64%	0,80%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	24.313	1.481.545	1.518.835	1,17%	0,29%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	24.314	1.478.880	1.516.409	0,93%	0,29%
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	162.092	9.776.570	10.028.185	5,24%	1,93%
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	48.787	3.047.306	3.122.763	1,95%	0,60%

MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	56.906	3.540.133	3.627.794	1,17%	0,70%
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	65.047	4.043.361	4.143.483	0,85%	0,80%
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	58.227	3.593.261	3.682.237	0,77%	0,71%
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	129.460	7.969.775	8.167.122	0,91%	1,57%
MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	48.459	2.980.805	3.046.999	0,43%	0,59%
MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	24.545	1.510.408	1.539.051	0,26%	0,30%
MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	32.523	2.000.540	2.030.597	0,34%	0,39%
MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	32.456	2.000.540	2.023.496	0,44%	0,39%
MKMINF20GL11 - DO2017/12-0432DK 6.4.2032 0:0:0 - EUR	113.459	7.001.890	7.063.712	3,08%	1,36%
MKMINF20GL52 - DO2017/16-0632DK 8.6.2032 0:0:0 - EUR	205.041	12.653.416	12.683.561	4,22%	2,44%
MKMINF20GL60 - DO2017/17-0632DK 22.6.2032 0:0:0 - EUR	198.557	12.253.308	12.264.965	3,55%	2,36%
MKMINF20GL78 - DO2017/18-0632DK 29.6.2032 0:0:0 - EUR	127.888	7.892.130	7.894.036	0,88%	1,52%
MKMINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	23.883	1.470.397	1.494.357	0,21%	0,29%
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		233.263.853	239.262.255		46,04%

Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки					
US912810RU43 - T 2 7/8 11/15/46 15.11.2046 0:0:0 - USD	80.000	4.414.458	4.368.371	0,00%	0,84%
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	82.000	4.431.890	4.210.200	0,00%	0,81%
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		8.846.348	8.578.571		1,65%
Вкупно инвестиции во обврзници		242.110.201	247.840.826		47,69%

(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					
Удели во отворени инвестициони фондови					
DE0002635307 - ISHARES STOXX EUROPE 600 UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.610	3.868.624	3.747.192	0,00%	0,72%
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.069	6.597.315	7.080.235	0,00%	1,36%
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	425	2.330.509	2.620.320	0,00%	0,50%
US4642865095 - ISHARES MSCI CANADA ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.650	3.907.244	3.833.894	0,00%	0,74%
US4642865251 - ISHARES EDGE MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.730	7.326.613	7.398.280	0,00%	1,42%
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.700	4.550.199	4.951.397	0,02%	0,95%

US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	600	927.730	1.065.277	0,00%	0,21%
US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	970	1.498.133	1.587.422	0,00%	0,31%
US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	200	1.366.923	1.303.051	0,00%	0,25%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	632	4.117.450	4.473.675	0,01%	0,86%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.180	2.858.967	2.264.741	0,00%	0,44%
US46429B6065 - ISHARES MSCI POLAND CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	555	586.533	728.534	0,00%	0,14%
US46434G8226 - ISHARES MSCI JAPAN INDEX - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.692	10.579.705	10.708.770	0,00%	2,06%
US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.150	1.502.213	1.372.793	0,00%	0,26%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.310	15.765.803	15.727.142	0,00%	3,03%
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		67.783.960	68.862.723		13,25%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		67.783.960	68.862.723		13,25%

(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	8.079.452	8.106.230	1,56%
Долгорочни депозити	55.400.000	55.591.993	10,70%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	63.479.452	63.698.223	12,26%

7. Структура на инвестициите на ОДФФ НЛБ Пензија Плус по видови на финансиски средства на ден 30.06.2017

ОПИС	Вкупна вредност на денот на известувањето (во денари)	Процентуален удел во вредноста на пензискиот фонд
Акции	133.565.031	25,70%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	247.840.826	47,69%
Краткорочни хартии од вредност	0	0,00%
Акции и удели во инвестициони фондови	68.862.723	13,25%
Парични средства	3.449.055	0,66%
Пласмани и депозити	63.698.223	12,26%
Останати средства	2.279.403	0,44%
Вкупно средства	519.695.261	100,00%

8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОДФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 30.06.2017

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	4.335.700	4.441.604	105.904
29.3.2017	MKMINF200DF7 - RMDEN15	73.500	4.335.700	4.441.604	105.904
	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	40.000	2.475.482	2.409.382	-66.100
7.4.2017	FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26	40.000	2.475.482	2.409.382	-66.100
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	6.116	11.919.090	12.604.876	685.786

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
19.4.2017	US46429B6065 - EPOL	555	586.533	710.567	124.034
22.6.2017	US46434G8309 - EWI UP	535	755.456	814.584	59.128
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				1.033.478

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 30.06.2017

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 постоат на крајот на периодот	Загуба поради оштетување
1	2	3	4	5	6	7	8	9
	Обични акции издадени во Република Македонија	59.534.247	65.377.672	0	5.843.425	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.636.956	7.151.760	0	514.804	0	0	0
	МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	672.000	720.000	0	48.000	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.376.940	10.673.377	0	2.296.437	0	0	0
	МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	5.897.459	5.459.855	0	-437.604	0	0	0
	МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.768.436	9.718.880	0	-49.556	0	0	0
	МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	4.574.400	6.120.000	0	1.545.600	0	0	0
	МКРРИV101019 - 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	7.040.000	0	160.000	0	0	0

	МКВИТА101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	4.386.255	4.408.800	0	22.545	0	0	0
	МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.095.800	3.365.000	0	269.200	0	0	0
	Приоритетни акции издадени во Република Македонија							
	Акции во затворени инвестициони фондови издадени во Република Македонија							
	Обични акции издадени од странски компании и банки	66.627.322	67.155.638	0	528.315	0	0	0
	BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.409.481	1.360.550	0	-48.931	0	0	0
	CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.732.012	2.899.867	0	167.855	0	0	0
	CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.743.953	1.963.594	0	219.641	0	0	0
	DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.333.895	3.064.314	0	-269.581	0	0	0
	DE0007164600 - SAP SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	625.637	620.704	0	-4.932	0	0	0
	DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.599.524	2.688.209	0	88.686	0	0	0
	DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.521.398	2.744.513	0	223.116	0	0	0
	DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.361.791	2.176.531	0	-185.260	0	0	0
	FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.082.690	1.183.533	0	100.843	0	0	0
	FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.556.758	2.587.617	0	30.859	0	0	0

	FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.453.592	2.963.363	0	509.771	0	0	0
	FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.617.398	2.762.617	0	145.219	0	0	0
	GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.129.695	2.034.386	0	-95.308	0	0	0
	NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.964.109	1.954.761	0	-9.349	0	0	0
	US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.571.490	1.708.915	0	137.426	0	0	0
	US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.673.356	1.831.688	0	158.333	0	0	0
	US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.961.398	2.141.632	0	180.234	0	0	0
	US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.654.831	3.060.015	0	405.184	0	0	0
	US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.332.144	2.068.584	0	-263.560	0	0	0
	US09075E1001 - BIOVERATIV INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	180.028	227.712	0	47.684	0	0	0
	US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.635.642	1.494.732	0	-140.911	0	0	0
	US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.668.549	1.673.092	0	4.542	0	0	0
	US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.819.118	1.569.789	0	-249.330	0	0	0
	US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	946.453	692.722	0	-253.731	0	0	0
	US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.532.783	1.625.510	0	92.726	0	0	0

	US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.768.917	1.765.517	0	-3.400	0	0	0
	US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.183.432	3.172.411	0	-11.021	0	0	0
	US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.539.162	1.790.227	0	251.064	0	0	0
	US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.500.812	2.571.376	0	70.564	0	0	0
	US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.370.991	2.362.840	0	-8.151	0	0	0
	US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.140.482	2.083.784	0	-56.698	0	0	0
	US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.553.014	1.979.889	0	-573.125	0	0	0
	US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.462.789	2.330.644	0	-132.145	0	0	0
	Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	945.357	1.031.721	0	86.364	0	0	0
	US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	945.357	1.031.721	0	86.364	0	0	0
	Акции во затворени инвестициони фондови издадени од странски компании и банки							
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	233.263.853	239.262.255	1.122.021	0	735.706	4.140.674	0

MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	9.980.055	10.110.260	0	0	0	130.205	0
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	621.349	658.832	10.916	0	4.706	21.861	0
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	1.860.863	1.877.930	-45.901	0	10.407	52.560	0
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	13.887.084	14.537.956	220.252	0	69.185	361.436	0
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	2.202.603	2.281.756	12.549	0	10.220	56.384	0
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	3.358.167	3.469.858	25.131	0	15.204	71.355	0
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	2.112.293	2.179.761	9.104	0	9.141	49.223	0
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	13.308.308	13.762.674	152.400	0	55.418	246.547	0
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	21.427.877	22.307.396	377.443	0	90.495	411.580	0
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	12.996.624	13.683.381	360.126	0	61.664	264.967	0
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	6.075.891	6.261.547	0	0	22.217	163.439	0
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	1.008.609	1.039.428	0	0	3.688	27.131	0
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	3.016.426	3.108.597	0	0	11.030	81.141	0
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	4.043.000	4.148.929	0	0	14.755	91.174	0
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	3.008.155	3.086.971	0	0	10.978	67.837	0
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.197.354	1.228.726	0	0	4.370	27.002	0

	MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	3.957.750	4.062.880	0	0	14.543	90.588	0
	MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	5.887.861	6.046.892	0	0	22.050	136.981	0
	MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	6.680.682	6.831.790	0	0	24.975	126.133	0
	MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	3.925.984	4.032.609	0	0	14.980	91.646	0
	MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	4.885.046	5.018.322	0	0	18.636	114.640	0
	MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	6.125.565	6.298.010	0	0	22.374	150.071	0
	MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	3.957.483	4.050.944	0	0	14.460	79.001	0
	MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	4.927.790	5.033.275	0	0	18.337	87.148	0
	MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	4.053.640	4.138.151	0	0	14.758	69.753	0
	MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	4.063.129	4.157.778	0	0	14.809	79.840	0
	MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.481.545	1.518.835	0	0	5.433	31.856	0
	MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	1.478.880	1.516.409	0	0	5.619	31.909	0
	MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	9.776.570	10.028.185	0	0	37.146	214.469	0
	MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	3.047.306	3.122.763	0	0	11.114	64.344	0
	MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	3.540.133	3.627.794	0	0	12.911	74.750	0

	MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	4.043.361	4.143.483	0	0	14.747	85.375	0
	MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	3.593.261	3.682.237	0	0	13.105	75.871	0
	MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	7.969.775	8.167.122	0	0	29.067	168.281	0
	MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	2.980.805	3.046.999	0	0	10.177	56.017	0
	MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	1.510.408	1.539.051	0	0	4.521	24.122	0
	MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	2.000.540	2.030.597	0	0	6.802	23.255	0
	MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	2.000.540	2.023.496	0	0	2.635	20.321	0
	MKMINF20GL11 - DO2017/12-0432DK 6.4.2032 0:0:0 - EUR	7.001.890	7.063.712	0	0	879	60.943	0
	MKMINF20GL52 - DO2017/16-0632DK 8.6.2032 0:0:0 - EUR	12.653.416	12.683.561	0	0	1.707	28.437	0
	MKMINF20GL60 - DO2017/17-0632DK 22.6.2032 0:0:0 - EUR	12.253.308	12.264.965	0	0	1.650	10.007	0
	MKMINF20GL78 - DO2017/18-0632DK 29.6.2032 0:0:0 - EUR	7.892.130	7.894.036	0	0	1.100	806	0
	MKMINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	1.470.397	1.494.357	0	0	3.692	20.269	0
	Обврзници издадени или гарантирани од Народна Банка на Република Македонија							
	Обврзници издадени или гарантирани од домашни банки							

	Обврзници издадени од домашни акционерски друштва, освен банки							
	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	8.846.348	8.578.571	290.403	0	-619.273	61.093	0
	US912810RU43 - Т 2 7/8 11/15/46 15.11.2046 0:0:0 - USD	4.414.458	4.368.371	198.094	0	-277.938	33.756	0
	US912828R366 - Т 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	4.431.890	4.210.200	92.309	0	-341.335	27.336	0
	Обврзници и други должнички хартии од вредност издадени од странски единици на локална самоуправа							
	Обврзници и други должнички хартии од вредност издадени од странски компании и банки							
	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 домашни банки							
	Хартии од вредност врз основа на хипотека издадени од домашни банки							
	Комерцијални записи издадени од домашни акционерски друштва, освен банки							

	Удели во домашни отворени инвестициони фондови							
	Други ненаведени домашни хартии од вредност							
	Трезорски записи издадени од странски влади							
	Благајнички записи издадени странски централни банки							
	Комерцијални записи издадени од странски компании и банки							
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	67.783.960	68.862.723	0	1.078.763	0	0	0
	DE0002635307 - ISHARES STOXX EUROPE 600 UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.868.624	3.747.192	0	-121.432	0	0	0
	DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	6.597.315	7.080.235	0	482.920	0	0	0
	US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.330.509	2.620.320	0	289.811	0	0	0
	US4642865095 - ISHARES MSCI CANADA ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.907.244	3.833.894	0	-73.349	0	0	0
	US4642865251 - ISHARES EDGE MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	7.326.613	7.398.280	0	71.667	0	0	0

	US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	4.550.199	4.951.397	0	401.199	0	0	0
	US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	927.730	1.065.277	0	137.547	0	0	0
	US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.498.133	1.587.422	0	89.289	0	0	0
	US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.366.923	1.303.051	0	-63.873	0	0	0
	US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	4.117.450	4.473.675	0	356.225	0	0	0
	US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.858.967	2.264.741	0	-594.226	0	0	0
	US46429B6065 - ISHARES MSCI POLAND CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	586.533	728.534	0	142.001	0	0	0
	US46434G8226 - ISHARES MSCI JAPAN INDEX - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	10.579.705	10.708.770	0	129.065	0	0	0
	US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.502.213	1.372.793	0	-129.420	0	0	0

	US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	15.765.803	15.727.142	0	-38.661	0	0	0
	Други ненаведени хартии од вредност издадени од странски влади и компании							
	ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	437.001.087	450.268.580	1.412.424	7.536.868	116.434	4.201.767	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	3.449.055	0	0	0	0	0	3.449.055
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	202.427.754	0	202.427.754
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	202.921.463	202.921.463
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	682.924	3.925.030	39.000.000	0	0	65.009.632	108.617.586
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	2.279.403	0	2.279.403

6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	4.131.978	3.925.030	39.000.000	0	204.707.157	267.931.096	519.695.261
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	2.275.437	0	2.275.437
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	2.275.437	0	2.275.437
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	4.131.978	3.925.030	39.000.000	0	202.431.720	267.931.096	517.419.824

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	3,83	2,58	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	3,29	4,21	0,00	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	3.449.055	0	0	0	3.449.055
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	202.427.754	0	0	0	202.427.754
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	202.921.463	0	0	0	202.921.463
4) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	8.772.053	6.807.739	49.000.000	44.037.794	108.617.586
5) Останати средства на пензискиот фонд	2.279.403	0	0	0	2.279.403
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	419.849.728	6.807.739	49.000.000	44.037.794	519.695.261
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	2.275.437	0	0	0	2.275.437
8) Вкупно обврски (6+7)	2.275.437	0	0	0	2.275.437
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	417.574.291	6.807.739	49.000.000	44.037.794	517.419.824
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	417.574.291	424.382.030	473.382.030	517.419.824	

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	2.393.012	0	1.056.043	0	0	3.449.055
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	65.377.672	36.968.528	95.218.094	0	4.863.461	202.427.754
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	10.110.260	184.232.632	8.578.571	0	0	202.921.463
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	63.164.659	44.919.604	28	0	533.294	108.617.586
5) Останати средства на пензискиот фонд	1.339.334	827.546	112.522	-	0	2.279.403
6) <i>Вкупни средства (1+2+3+4+5)</i>	142.384.938	266.948.310	104.965.258	0	5.396.755	519.695.261
Обврски	1.414.134	827.546	33.756	0	0	2.275.437

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