



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен
задолжителен пензиски фонд
НЛБ Пензиски фонд

За првите девет месеци од 2017 година

Содржина

1. Извештај за нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пезиски фонд на ден 30.09.2017	3
2. Извештај за работењето на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот 01.01.-30.09.2017	5
3. Извештај за промените на нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот 01.01.-30.09.2017	6
4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01.-30.09.2017	8
5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот 01.01-30.09.2017	9
6. Извештаи за структурата на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд на ден 30.09.2017	11
7. Структура на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд по видови на финансиски средства на ден 30.09.2017	24
8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот од 01.01.2017 до 30.09.2017	25
9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОЗПФ Пензиски Фонд за периодот од 01.01.2017 до 30.09.2017	27

1. Извештај за нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд на ден 30.09.2017

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	30.09.2016 (во 000 ден.)	30.09.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
1	10	Парични средства	3	71.710	4.518
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		2.155	44.211
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ	4	54.004	10.623
5	14	Побарувања од други пензиски фондови		0	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	0
11		Вложувања во хартии од вредност и депозити (12+13+14)	5	20.903.402	25.440.337
12	3	Финансиски средства кои се чуваат за тргување		6.080.409	7.647.350
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		9.366.937	10.341.753
14	5	Финансиски средства кои се чуваат до достасување		5.456.056	7.451.234
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		21.031.271	25.499.689
16	20	Обврски за неконвертирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		0	0
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		16	24
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	6	12.072	9.128
23	27	Обврски за брокерски и посреднички провизии		0	0
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		647	1.757
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		12.735	10.909
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		21.018.536	25.488.780
28		Број на издадени сметководствени единици		120.468.446,240802	135.793.042,595423
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		174,473373	187,703138
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		16.472.783	19.311.814
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		52.031	57.987
32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-51.108	-73.673
33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-179.606	-208.634
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		521.275	1.015.924
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		4.197.887	5.382.903
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	7	5.274	2.459
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		21.018.536	25.488.780

2. Извештај за работењето на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот 01.01.-30.09.2017

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	30.09.2016 (во 000 ден.)	30.09.2017 (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	8	455.520	523.754
2	71	Приходи од дивиденди	9	103.172	118.938
3	73	Реализирани капитални добивки	10	18.097	36.447
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		52.993	30.644
5	75	Други неспоменати приходи	11	1.274	1.650
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		631.056	711.433
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	12	70.504	75.507
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	13	21.745	2.560
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		49.273	34.406
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	14	850	811
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		0	0
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		142.372	113.284
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		488.684	598.149
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	15	51.551	478.981
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		-18.960	-61.206
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		32.591	417.775
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		521.275	1.015.924

3. Извештај за промените на нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот 01.01.-30.09.2017

Ознака на позиција	Група на сметки	ПОЗИЦИЈА	30.09.2016 (во 000 ден.)	30.09.2017 (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	488.684	598.149
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	32.591	417.775
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	-7.778	11.206
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	513.497	1.027.130
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	1.951.910	2.139.935
6	91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	1.647	4.349
7	92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-13.466	-15.017
8	93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-13.054	-26.417
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	1.927.037	2.102.850
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	2.440.534	3.129.980
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	18.578.003	22.358.800
12		На крајот на периодот (10+11)	21.018.536	25.488.780
		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	11.456.392,108211	11.620.390,997225

14		Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	9.711,077094	23.640,801357
15		Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-79.287,273393	-81.678,573770
16		Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-76.479,549763	-143.073,754386
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	11.310.336,362149	11.419.279,470426

4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01.-30.09.2017

Ознака на позиција	ПОЗИЦИЈА	30.09.2016 (во 000 ден.)	30.09.2017 (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	18.578.003	22.358.800
2	Број на сметководствени единици на почетокот на периодот	109.158.109,878653	124.373.763,124997
3	Вредност на сметководствената единица на почетокот на периодот (1/2)	170,193521	179,771032
	Вредноста на нето средствата на пензискиот фонд по сметководствена единица на крајот на периодот		
4	Нето средства на пензискиот фонд на крајот на периодот	21.018.536	25.488.780
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	120.468.446,240802	135.793.042,595423
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	174,473373	187,703138
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,003614	0,003165
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,024753	0,024809
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	6,21%	6,34%

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

19.742.074

24.110.104

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

Приносот прикажан за 2017 и 2016 година е номинален седумгодишен принос сведен на годишно ниво пресметан согласно Законската регулатива за тој извештаен период.

Реалниот седумгодишен принос сведен на годишно ниво изнесува 4,70% за 2017, односно 4,44% за 2016 година.

**5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОЗПФ НЛБ
Пензиски Фонд за периодот 01.01-30.09.2017**

реден број	П О З И Ц И Ј А	Број на сметководствени единици	Извори на средствата на фондот
1	2	3	4
1	На почетокот на периодот	124.373.763,124997	16.984.644
2	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	11.620.390,997225	2.139.935
3	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство во текот на периодот	23.640,801357	4.349
4	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-81.678,573770	-15.017
5	Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-143.073,754386	-26.417
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	135.793.042,595423	19.087.494
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		179,771032
	На крајот на периодот		187,703138

6. Извештаи за структурата на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд на ден 30.09.2017

(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	45.030	5.387	242.590.450	7.538	339.431.187	3,15%	1,33%
МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	561	42.000	23.562.000	53.108	29.793.588	3,12%	0,12%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	212.968	580	123.521.440	850	181.022.800	6,93%	0,71%
МККМBS101019 - КОМЕРЦИЈАЛНА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.546	2.854	18.685.361	2.865	18.755.665	0,29%	0,07%
МКМТSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	456.044	260	118.610.040	280	127.596.551	0,48%	0,50%
МКМTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	39.222	3.699	145.072.373	4.899	192.148.578	8,68%	0,75%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.720	3.812	33.240.640	5.800	50.576.000	1,99%	0,20%
МКРPIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.952	34.986	68.292.000	38.000	74.176.000	4,88%	0,29%
МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.848	43.055	79.565.610	52.000	96.096.000	7,11%	0,38%
МКТЕТЕ101016 - ТЕТЕКС АД ТЕТОВО - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.697	935	10.001.695	1.980	21.180.060	2,58%	0,08%

МКВІТА101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.843	8.784	16.189.585	7.920	14.596.560	2,39%	0,06%
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.010	2.300	13.823.000	3.248	19.520.480	2,23%	0,08%
МКЗРКО101012 - ЗК ПЕЛАГОНИЈА АД БИТОЛА - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.370	2.500	8.425.000	2.501	8.428.370	1,66%	0,03%
Приоритетни акции							
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			901.579.193		1.173.321.838		4,60%
Обични акции							
BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.980	6.182	61.695.708	6.227	62.142.550	0,00%	0,24%
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	24.541	4.242	104.109.171	4.448	109.150.218	0,00%	0,43%
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.159	4.182	55.032.803	4.351	57.256.074	0,00%	0,22%
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	18.950	5.456	103.399.851	5.276	99.976.380	0,00%	0,39%
DE0006048408 - HENKEL AG & CO. KGAА ST - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.700	6.085	46.857.651	6.328	48.726.606	0,00%	0,19%
DE0007164600 - SAP SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.500	5.681	48.288.966	5.697	48.428.486	0,00%	0,19%
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	15.988	7.151	114.335.210	7.327	117.143.846	0,00%	0,46%
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.471	9.758	102.172.752	11.676	122.257.790	0,00%	0,48%
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	18.170	5.429	98.652.285	5.535	100.563.295	0,00%	0,39%
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.056	4.728	47.543.805	5.164	51.928.447	0,00%	0,20%
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	77.608	1.467	113.820.422	1.573	122.074.755	0,00%	0,48%

FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.199	11.153	91.440.903	14.350	117.653.228	0,00%	0,46%
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	29.810	3.708	110.530.237	4.195	125.058.644	0,00%	0,49%
GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	47.258	1.504	71.064.681	1.572	74.277.136	0,00%	0,29%
NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	20.300	4.425	89.821.638	4.943	100.335.630	0,00%	0,39%
US02079K3059 - ALPHABET INC -	1.610	46.220	74.414.651	50.697	81.621.895	0,00%	0,32%
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.800	48.296	86.932.676	50.053	90.095.011	0,00%	0,35%
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.550	8.528	81.440.635	9.708	92.706.987	0,00%	0,36%
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.212	6.755	89.250.946	8.024	106.016.698	0,00%	0,42%
US09062X1037 - BIOGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	5.325	16.540	88.075.662	16.303	86.811.473	0,00%	0,34%
US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.100	6.108	61.690.619	6.118	61.788.257	0,00%	0,24%
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	30.350	2.418	73.391.996	2.343	71.123.712	0,00%	0,28%
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	57.000	1.727	98.419.976	1.259	71.759.245	0,00%	0,28%
US4062161017 - HALLIBURTON COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	23.300	3.155	73.507.831	2.397	55.839.768	0,00%	0,22%
US4370761029 - THE HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.340	7.820	73.041.819	8.516	79.537.271	0,00%	0,31%
US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.148	7.244	95.247.928	7.380	97.028.391	0,00%	0,38%
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	25.114	4.991	125.341.259	4.973	124.885.335	0,00%	0,49%
US5184391044 - THE ESTEE LAUDER COMPANIES INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.200	4.461	58.889.694	5.615	74.114.045	0,01%	0,29%

US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	29.630	3.624	107.389.941	3.878	114.914.897	0,00%	0,45%
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	17.620	6.776	119.400.877	7.017	123.636.254	0,00%	0,48%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	36.880	3.184	117.426.723	2.796	103.131.841	0,00%	0,40%
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	32.800	3.113	102.120.543	2.577	84.515.819	0,00%	0,33%
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	33.925	3.132	106.263.595	2.871	97.411.915	0,00%	0,38%
Приоритетни акции							
US02079K1079 - ALPHABET INC -	1.163	45.017	52.354.793	49.936	58.075.752	0,00%	0,23%
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			2.943.368.248		3.031.987.649		11,89%
Вкупно вложувања во акции			3.844.947.441		4.205.309.487		16,49%

(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					
MKMINF20G499 - DO2013/01-0118 9.1.2018 0:0:0 - MKD	185.000.000	184.751.011	192.440.284	100,00%	0,75%

MKMINF20G507 - DO2013/03-0118 24.1.2018 0:0:0 - MKD	60.000.000	59.791.139	62.173.925	100,00%	0,24%
MKMINF20GA71 - DO2014/25-1019 16.10.2019 0:0:0 - MKD	70.000.000	70.576.198	72.620.248	5,81%	0,28%
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	240.000.000	239.507.669	244.239.123	96,00%	0,96%
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	136.824	7.911.062	8.413.556	4,56%	0,03%
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	386.957	22.597.922	22.843.183	8,41%	0,09%
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	1.305.885	75.740.188	79.273.565	14,51%	0,31%
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	820	47.261	48.473	0,02%	0,00%
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	2.012	115.812	119.931	0,04%	0,00%
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	590.398	33.594.873	35.012.621	7,57%	0,14%
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	1.259.450	71.345.992	74.062.571	17,99%	0,29%
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	1.618.765	91.362.441	95.192.320	21,30%	0,37%
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	3.049.682	171.338.301	174.651.628	28,24%	0,68%
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017-DK 4.10.2017 0:0:0 - EUR	1.950.982	121.515.600	126.444.613	95,24%	0,50%
MKMINF20G390 - DO2012/14-1017-DK 18.10.2017 0:0:0 - EUR	1.951.128	121.275.809	126.195.095	92,66%	0,49%
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117-DK 1.11.2017 0:0:0 - EUR	1.951.178	121.030.588	125.939.927	38,19%	0,49%
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117-DK 23.11.2017 0:0:0 - EUR	6.862.391	424.283.896	441.509.326	83,51%	1,73%
MKMINF20G481 - DO2013/02-0118-DK 9.1.2018 0:0:0 - EUR	7.007.560	430.259.626	447.447.092	18,50%	1,75%
MKMINF20G523 - DO2013/05-0218-DK 28.2.2018 0:0:0 - EUR	973.762	59.365.203	61.646.615	11,17%	0,24%

MKMINF20G549 - DO2013/07-0318-DK 7.3.2018 0:0:0 - EUR	1.297.421	79.016.601	82.057.079	100,00%	0,32%
MKMINF20G556 - DO2013/08-0318-DK 14.3.2018 0:0:0 - EUR	1.459.066	88.771.558	92.191.876	84,91%	0,36%
MKMINF20G572 - DO2013/10-0418-DK 4.4.2018 0:0:0 - EUR	1.297.526	78.690.756	81.748.793	31,77%	0,32%
MKMINF20G580 - DO2013/11-0418-DK 25.4.2018 0:0:0 - EUR	973.394	58.909.877	61.086.976	35,29%	0,24%
MKMINF20G606 - DO2013/13-0518-DK 30.5.2018 0:0:0 - EUR	2.920.182	175.863.646	182.423.095	70,18%	0,72%
MKMINF20G671 - DO2013/20-0718DK 18.7.2018 0:0:0 - EUR	1.945.368	116.583.564	120.681.627	44,77%	0,47%
MKMINF20G705 - DO2013/23-0718DK 25.7.2018 0:0:0 - EUR	973.457	58.284.891	60.335.927	34,71%	0,24%
MKMINF20G721 - DO2013/25-0818DK 30.8.2018 0:0:0 - EUR	3.008.345	179.272.105	185.635.829	45,65%	0,73%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	3.901.963	242.566.022	250.799.705	55,22%	0,98%
MKMINF20G762 - DO2013/29-1018DK 17.10.2018 0:0:0 - EUR	975.589	60.544.667	62.599.163	46,86%	0,25%
MKMINF20G770 - DO2013/30-1018DK 31.10.2018 0:0:0 - EUR	1.300.760	80.587.241	83.321.200	53,69%	0,33%
MKMINF20G788 - DO2013/31-1118DK 21.11.2018 0:0:0 - EUR	2.276.116	140.650.268	145.422.040	57,38%	0,57%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	1.462.898	90.243.630	93.304.944	60,65%	0,37%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.621.644	99.778.902	103.163.463	32,11%	0,40%
MKMINF20G838 - DO2014/01-0119DK 23.1.2019 0:0:0 - EUR	1.621.771	99.429.600	102.816.848	25,41%	0,40%
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	729.513	44.524.228	46.050.842	15,74%	0,18%
MKMINF20G903 - DO2014/08-0319DK 27.3.2019 0:0:0 - EUR	486.265	29.567.891	30.590.480	24,27%	0,12%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	2.431.844	147.191.583	152.305.741	68,34%	0,60%

MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	1.461.929	88.333.382	91.415.167	56,25%	0,36%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	4.863.947	293.074.543	303.343.804	70,96%	1,19%
MKMINF20G960 - DO2014/14-0619DK 19.6.2019 0:0:0 - EUR	972.763	58.510.491	60.564.675	32,17%	0,24%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	3.493.685	209.972.477	217.875.195	83,66%	0,85%
MKMINF20GA06 - DO2014/18-0824DK 21.8.2024 0:0:0 - EUR	1.219.685	72.869.320	75.643.635	12,51%	0,30%
MKMINF20GA14 - DO2014/19-0924DK 4.9.2024 0:0:0 - EUR	813.169	48.293.505	50.167.939	79,37%	0,20%
MKMINF20GA30 - DO2014/21-1017DK 2.10.2017 0:0:0 - EUR	810.985	50.340.626	51.535.591	12,77%	0,20%
MKMINF20GA89 - DO2014/26-1019DK 16.10.2019 0:0:0 - EUR	5.352.407	333.020.211	341.705.133	43,54%	1,34%
MKMINF20GC79 - DO2015/05-0230DK 12.2.2030 0:0:0 - EUR	2.113.649	129.353.151	133.207.357	44,29%	0,52%
MKMINF20GD03 - DO2015/08-0230DK 26.2.2030 0:0:0 - EUR	813.011	49.680.499	51.160.178	58,82%	0,20%
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	4.215.947	257.197.416	264.872.232	31,74%	1,04%
MKMINF20GD52 - DO2015/13-0330DK 26.3.2030 0:0:0 - EUR	972.578	59.236.747	61.015.539	18,78%	0,24%
MKMINF20GD78 - DO2015/15-0430DK 16.4.2030 0:0:0 - EUR	2.759.037	167.671.621	172.700.562	61,92%	0,68%
MKMINF20GD94 - DO2015/17-0530DK 7.5.2030 0:0:0 - EUR	1.462.088	88.642.491	91.320.066	35,94%	0,36%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	2.924.727	177.384.072	182.060.921	88,80%	0,71%
MKMINF20GE36 - DO2015/21-0625DK 25.6.2025 0:0:0 - EUR	1.945.052	117.570.183	120.688.455	100,00%	0,47%
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	3.079.626	185.889.240	190.819.658	97,94%	0,75%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	3.079.626	185.390.287	191.034.019	30,22%	0,75%

MKMINF20GE93 - DO2015/27-0725DK 23.7.2025 0:0:0 - EUR	2.269.287	136.802.763	140.431.716	93,33%	0,55%
MKMINF20GF27 - DO2015/30-0825DK 6.8.2025 0:0:0 - EUR	1.137.601	68.490.803	70.309.061	82,35%	0,28%
MKMINF20GF76 - DO2015/35-0825DK 27.8.2025 0:0:0 - EUR	1.951.457	117.243.018	120.370.343	87,62%	0,47%
MKMINF20GG34 - DO2015/41-1030DK 29.10.2030 0:0:0 - EUR	4.378.319	271.066.089	279.067.087	69,30%	1,09%
MKMINF20GH09 - DO2016/02-0131DK 14.1.2031 0:0:0 - EUR	1.623.703	99.704.140	102.653.201	51,81%	0,40%
MKMINF20GH17 - DO2016/03-0131DK 22.1.2031 0:0:0 - EUR	2.431.374	149.132.696	153.882.863	40,49%	0,60%
MKMINF20GH74 - DO2016/07-0231DK 11.2.2031 0:0:0 - EUR	1.134.606	69.422.618	71.647.306	76,42%	0,28%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.945.077	118.523.617	122.333.309	93,53%	0,48%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	2.431.382	147.881.807	152.666.402	92,88%	0,60%
MKMINF20GI24 - DO2016/12-0431DK 14.4.2031 0:0:0 - EUR	1.378.565	83.720.588	86.423.951	68,55%	0,34%
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	1.296.737	78.212.561	80.771.206	41,88%	0,32%
MKMINF20GI81 - DO2016/18-0826DK 18.8.2026 0:0:0 - EUR	2.276.712	136.720.458	140.572.797	90,52%	0,55%
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	2.276.712	136.183.750	140.669.131	90,91%	0,55%
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	2.276.230	135.551.521	140.052.473	46,90%	0,55%
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	5.691.640	338.666.505	349.897.110	74,39%	1,37%
MKMINF20GJ64 - DO2016/26-1131DK 3.11.2031 0:0:0 - EUR	4.385.032	271.417.586	280.034.592	50,68%	1,10%
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	4.366.085	269.374.072	277.926.197	57,73%	1,09%
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	11.655.480	717.348.259	740.124.126	82,37%	2,90%

MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	7.074.710	444.506.016	451.418.813	62,15%	1,77%
MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	3.246.885	199.761.501	204.689.022	34,74%	0,80%
MKMINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	7.147.360	439.931.500	449.602.864	62,84%	1,76%
MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	2.439.223	150.011.500	153.116.846	25,48%	0,60%
MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	2.434.168	150.011.500	152.581.308	32,86%	0,60%
MKMINF20GL11 - DO2017/12-0432DK 6.4.2032 0:0:0 - EUR	3.079.611	190.011.501	192.761.034	83,70%	0,76%
MKMINF20GL37 - DO2017/14-0532DK 4.5.2032 0:0:0 - EUR	1.444.432	89.011.500	90.158.747	48,11%	0,35%
MKMINF20GL52 - DO2017/16-0632DK 8.6.2032 0:0:0 - EUR	1.989.788	122.771.500	123.751.630	40,92%	0,49%
MKMINF20GL60 - DO2017/17-0632DK 22.6.2032 0:0:0 - EUR	2.204.717	136.031.500	136.921.689	39,42%	0,54%
MKMINF20GL78 - DO2017/18-0632DK 29.6.2032 0:0:0 - EUR	2.302.305	142.051.500	142.879.650	15,78%	0,56%
MKMINF20GL86 - DO2017/19-0732DK 6.7.2032 0:0:0 - EUR	2.431.398	150.011.500	150.782.680	32,63%	0,59%
MKMINF20GL94 - DO2017/20-0732DK 20.7.2032 0:0:0 - EUR	1.624.716	100.011.500	100.616.363	86,21%	0,39%
MKMINF20GM02 - DO2017/21-0822DK 10.8.2022 0:0:0 - EUR	6.504.594	400.011.501	401.216.672	98,77%	1,57%
MKMINF20GM10 - DO2017/22-0832DK 10.8.2032 0:0:0 - EUR	13.009.188	800.011.501	803.835.221	81,41%	3,15%
MKMINF20GM28 - DO2017/23-0822DK 17.8.2022 0:0:0 - EUR	1.300.910	80.011.500	80.213.842	100,00%	0,31%
MKMINF20GM36 - DO2017/24-0832DK 17.8.2032 0:0:0 - EUR	6.504.552	400.011.500	401.633.550	45,43%	1,58%
MKMINF20GM77 - DO2017/27-0932DK 21.9.2032 0:0:0 - EUR	2.919.448	180.011.500	179.629.043	14,33%	0,70%

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		14.268.960.753	14.643.581.695		57,43%
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	3.000.000	166.035.158	158.318.580	0,01%	0,62%
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	4.000.000	216.161.451	198.693.438	0,01%	0,78%
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		382.196.610	357.012.018		1,40%
Вкупно инвестиции во обврзници		14.651.157.362	15.000.593.713		58,83%

(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					
DE0002635307 - ISHARES STOXX EUROPE 600 UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	83.400	198.687.889	195.829.672	0,05%	0,77%
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	66.013	408.767.419	452.716.148	0,08%	1,78%
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	25.860	138.630.905	166.859.784	0,28%	0,65%
US4642865095 - ISHARES MSCI CANADA ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	104.320	153.215.740	157.185.620	0,10%	0,62%
US4642865251 - ISHARES EDGE MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	62.600	265.113.275	265.239.821	0,14%	1,04%

US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	112.809	189.034.068	210.738.018	0,84%	0,83%
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	40.620	62.807.333	71.356.198	0,09%	0,28%
US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	9.000	61.511.555	56.806.669	0,00%	0,22%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	33.680	219.351.433	249.653.279	0,33%	0,98%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	71.600	173.476.327	139.533.843	0,24%	0,55%
US46429B6065 - ISHARES MSCI POLAND CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	22.500	23.778.379	31.067.245	0,17%	0,12%
US46434G8226 - ISHARES MSCI JAPAN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	154.800	444.146.424	449.004.632	0,05%	1,76%
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	113.516	208.492.504	223.583.694	0,29%	0,88%
US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	39.000	50.004.646	46.621.173	0,01%	0,18%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	60.315	725.211.101	724.657.129	0,02%	2,84%
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		3.322.228.998	3.440.852.926		13,49%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		3.322.228.998	3.440.852.926		13,49%

(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	262.581.776	262.841.977	1,03%
Долгорочни депозити	2.516.316.923	2.530.738.490	9,92%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	2.778.898.698	2.793.580.467	10,96%

7. Структура на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд по видови на финансиски средства на ден 30.09.2017

ОПИС	Вкупна вредност на денот на известувањето (во денари)	Процентуален удел во вредноста на пензискиот фонд
Акции	4.205.309.487	16,49%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	15.000.593.713	58,83%
Краткорочни хартии од вредност	0	0,00%
Акции и удели во инвестициони фондови	3.440.852.926	13,49%
Парични средства	4.518.601	0,02%
Пласмани и депозити	2.793.580.467	10,96%
Останати средства	54.834.198	0,22%
Вкупно средства	25.499.689.392	100,00%

8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот од 01.01.2017 до 30.09.2017

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	2.000	10.774.615	11.400.000	625.385
23.03.2017	MKALKA101011 - ALK	2.000	10.774.615	11.400.000	625.385
	Обични акции издадени од странски компании и банки	58.412	283.083.977	297.062.499	13.978.522
16.03.2017	BE0974293251 - ABI	4.700	29.055.093	29.715.421	660.328
16.03.2017	CH0038863350 - NESN	7.000	29.274.992	30.860.390	1.585.398
16.03.2017	DE0006048408 - HEN	4.800	29.209.964	30.486.604	1.276.640
18.01.2017	DE0008404005 - ALV	900	8.687.294	8.786.184	98.890
04.08.2017	DE0008404005 - ALV	600	5.854.613	6.820.377	965.764
18.01.2017	DE000BASF111 - BAS	2.500	13.573.512	13.652.023	78.511
16.03.2017	FR0000120578 - SAN	10.000	47.279.043	50.846.349	3.567.307
18.01.2017	FR0000121014 - MC	1.100	12.267.959	12.634.912	366.953
20.01.2017	FR0000131104 - BNP	3.500	13.029.403	12.942.098	-87.306
15.02.2017	US0378331005 - AAPL	3.000	20.265.882	23.521.250	3.255.368
12.09.2017	US09075E1001 - BIVV	2.662	6.846.201	7.764.992	918.791
16.03.2017	US5184391044 - EL	4.000	17.845.362	19.782.748	1.937.386
20.01.2017	US6934751057 - PNC	2.000	13.643.571	13.427.888	-215.684
24.02.2017	US9182041080 - VFC	11.650	36.251.089	35.821.264	-429.825
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	46.403	1.567.150	1.669.718	102.568
31.05.2017	MKMINF200D68 - РМДЕН06	8.658	0	11.403	11.403
31.05.2017	MKMINF200D76 - РМДЕН07	1.438	0	2.814	2.814
31.05.2017	MKMINF200D84 - РМДЕН08	9.307	0	20.782	20.782
27.09.2017	MKMINF200DF7 - RMDEN15	27.000	1.567.150	1.634.719	67.569

	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	1.000.000	61.887.056	60.234.550	-1.652.506
07.04.2017	FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26	1.000.000	61.887.056	60.234.550	-1.652.506
	Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија	7.000	69.278.029	69.489.280	211.251
25.01.2017	MKMINFDYG105 - DZ2016/10-364	7.000	69.278.029	69.489.280	211.251
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	238.745	537.224.897	557.847.793	20.622.896
17.01.2017	US4642867075 - EWQ	13.860	19.943.119	20.273.923	330.804
18.01.2017	US4642867075 - EWQ	13.859	19.941.680	19.950.593	8.913
17.01.2017	US4642868065 - EWG	47.600	73.516.638	75.098.057	1.581.419
18.01.2017	US4642868065 - EWG	47.600	73.516.638	74.422.542	905.904
16.03.2017	US4642874659 - EFA	21.773	73.312.924	78.258.512	4.945.588
19.04.2017	US46429B6065 - EPOL	22.500	23.778.379	28.794.731	5.016.352
22.06.2017	US46434G8309 - EWI UP	22.553	31.846.361	34.326.438	2.480.077
28.06.2017	US46434G8309 - EWI UP	1.000	1.412.068	1.527.330	115.262
16.03.2017	US78463X8487 - CWI	35.000	64.283.780	69.111.527	4.827.747
17.01.2017	US9229083632 - VOO	6.500	77.836.655	78.421.597	584.942
18.01.2017	US9229083632 - VOO	6.500	77.836.655	77.662.541	-174.114
	ВКУПНО РЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ				33.888.116

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

9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОЗПФ Пензиски Фонд за периодот од 01.01.2017 до 30.09.2017

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 доспеваат на фиксен датум*	Загуба поради оштетување
1	2	3	4	5	6	7	8	9
	Обични акции издадени во Република Македонија	901.579.193	1.173.321.838	0	271.742.645	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	242.590.450	339.431.187	0	96.840.737	0	0	0
	МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	23.562.000	29.793.588	0	6.231.588	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	123.521.440	181.022.800	0	57.501.360	0	0	0
	МККMBS101019 - КОМЕРЦИЈАЛНА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	18.685.361	18.755.665	0	70.304	0	0	0
	МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	118.610.040	127.596.551	0	8.986.511	0	0	0

	МКМТУР101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИС Т АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	145.072.373	192.148.578	0	47.076.206	0	0	0
	МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	33.240.640	50.576.000	0	17.335.360	0	0	0
	МКРРИВ101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	68.292.000	74.176.000	0	5.884.000	0	0	0
	МКРЕРЛ101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	79.565.610	96.096.000	0	16.530.390	0	0	0
	МКТЕТЕ101016 - ТЕТЕКС АД ТЕТОВО - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.001.695	21.180.060	0	11.178.365	0	0	0
	МКВИТА101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	16.189.585	14.596.560	0	-1.593.025	0	0	0
	МКВУТК101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.823.000	19.520.480	0	5.697.480	0	0	0
	МКЗРКО101012 - ЗК ПЕЛАГОНИЈА АД БИТОЛА - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.425.000	8.428.370	0	3.370	0	0	0
	Обични акции издадени од странски компании и банки	2.891.013.455	2.973.911.897	0	82.898.442	0	0	0

	BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	61.695.708	62.142.550	0	446.842	0	0	0
	CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	104.109.171	109.150.218	0	5.041.047	0	0	0
	CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	55.032.803	57.256.074	0	2.223.271	0	0	0
	DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	103.399.851	99.976.380	0	-3.423.470	0	0	0
	DE0006048408 - HENKEL AG & CO. KGAA ST - ОБИЧНИ АКЦИИ	46.857.651	48.726.606	0	1.868.955	0	0	0
	DE0007164600 - SAP SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	48.288.966	48.428.486	0	139.520	0	0	0
	DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	114.335.210	117.143.846	0	2.808.636	0	0	0
	DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	102.172.752	122.257.790	0	20.085.038	0	0	0
	DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	98.652.285	100.563.295	0	1.911.011	0	0	0
	FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	47.543.805	51.928.447	0	4.384.641	0	0	0
	FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	113.820.422	122.074.755	0	8.254.332	0	0	0

	FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	91.440.903	117.653.228	0	26.212.325	0	0	0
	FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	110.530.237	125.058.644	0	14.528.407	0	0	0
	GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	71.064.681	74.277.136	0	3.212.455	0	0	0
	NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	89.821.638	100.335.630	0	10.513.993	0	0	0
	US02079K3059 - ALPHABET INC -	74.414.651	81.621.895	0	7.207.244	0	0	0
	US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	86.932.676	90.095.011	0	3.162.335	0	0	0
	US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	81.440.635	92.706.987	0	11.266.352	0	0	0
	US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	89.250.946	106.016.698	0	16.765.751	0	0	0
	US09062X1037 - BIOGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	88.075.662	86.811.473	0	-1.264.188	0	0	0
	US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	61.690.619	61.788.257	0	97.638	0	0	0
	US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.391.996	71.123.712	0	-2.268.284	0	0	0

	US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	98.419.976	71.759.245	0	-26.660.732	0	0	0
	US4062161017 - HALLIBURTON COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.507.831	55.839.768	0	-17.668.063	0	0	0
	US4370761029 - THE HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.041.819	79.537.271	0	6.495.452	0	0	0
	US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	95.247.928	97.028.391	0	1.780.463	0	0	0
	US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	125.341.259	124.885.335	0	-455.925	0	0	0
	US5184391044 - THE ESTEE LAUDER COMPANIES INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	58.889.694	74.114.045	0	15.224.351	0	0	0
	US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	107.389.941	114.914.897	0	7.524.956	0	0	0
	US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	119.400.877	123.636.254	0	4.235.377	0	0	0
	US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	117.426.723	103.131.841	0	-14.294.882	0	0	0
	US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	102.120.543	84.515.819	0	-17.604.724	0	0	0

	US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	106.263.595	97.411.915	0	-8.851.680	0	0	0
	Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	52.354.793	58.075.752	0	5.720.959	0	0	0
	US02079K1079 - ALPHABET INC -	52.354.793	58.075.752	0	5.720.959	0	0	0
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	14.268.960.753	14.643.581.695	-399.800	-5.463	-8.416.199	383.442.406	0
	MKMINF20G499 - DO2013/01-0118 9.1.2018 0:0:0 - MKD	184.751.011	192.440.284	0	0	0	7.689.273	0
	MKMINF20G507 - DO2013/03-0118 24.1.2018 0:0:0 - MKD	59.791.139	62.173.925	0	0	0	2.382.786	0
	MKMINF20GA71 - DO2014/25-1019 16.10.2019 0:0:0 - MKD	70.576.198	72.620.248	0	0	0	2.044.049	0
	MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	239.507.669	244.239.123	0	0	0	4.731.454	0
	MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	7.911.062	8.413.556	171.412	2.522	27.731	300.830	0
	MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	22.597.922	22.843.184	-703.791	-7.985	35.320	921.718	0
	MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	75.740.188	79.273.565	124.894	0	75.891	3.332.592	0

MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	47.261	48.473	-217	0	35	1.393	0
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	115.812	119.931	935	0	52	3.132	0
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	33.594.873	35.012.621	123.274	0	14.414	1.280.059	0
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	71.345.992	74.062.571	246.997	0	24.669	2.444.913	0
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	91.362.441	95.192.320	1.265.129	0	24.936	2.539.814	0
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	171.338.301	174.651.628	-1.628.432	0	39.260	4.902.500	0
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017-DK 4.10.2017 0:0:0 - EUR	121.515.600	126.444.613	0	0	-36.260	4.965.273	0
MKMINF20G390 - DO2012/14-1017-DK 18.10.2017 0:0:0 - EUR	121.275.809	126.195.095	0	0	-36.189	4.955.475	0
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117-DK 1.11.2017 0:0:0 - EUR	121.030.588	125.939.927	0	0	-36.116	4.945.455	0
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117-DK 23.11.2017 0:0:0 - EUR	424.283.896	441.509.326	0	0	-126.638	17.352.068	0
MKMINF20G481 - DO2013/02-0118-DK 9.1.2018 0:0:0 - EUR	430.259.626	447.447.092	0	0	-122.714	17.310.179	0

MKMINF20G523 - DO2013/05-0218-DK 28.2.2018 0:0:0 - EUR	59.365.203	61.646.615	0	0	-15.575	2.296.987	0
MKMINF20G549 - DO2013/07-0318-DK 7.3.2018 0:0:0 - EUR	79.016.601	82.057.079	0	0	-22.202	3.062.681	0
MKMINF20G556 - DO2013/08-0318-DK 14.3.2018 0:0:0 - EUR	88.771.558	92.191.876	0	0	-25.072	3.445.390	0
MKMINF20G572 - DO2013/10-0418-DK 4.4.2018 0:0:0 - EUR	78.690.756	81.748.793	0	0	-8.936	3.066.973	0
MKMINF20G580 - DO2013/11-0418-DK 25.4.2018 0:0:0 - EUR	58.909.877	61.086.976	0	0	-15.027	2.192.126	0
MKMINF20G606 - DO2013/13-0518-DK 30.5.2018 0:0:0 - EUR	175.863.646	182.423.095	0	0	-27.586	6.587.035	0
MKMINF20G671 - DO2013/20-0718DK 18.7.2018 0:0:0 - EUR	116.583.564	120.681.627	0	0	-27.602	4.125.665	0
MKMINF20G705 - DO2013/23-0718DK 25.7.2018 0:0:0 - EUR	58.284.891	60.335.927	0	0	-14.826	2.065.862	0
MKMINF20G721 - DO2013/25-0818DK 30.8.2018 0:0:0 - EUR	179.272.105	185.635.829	0	0	-30.535	6.394.258	0
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	242.566.022	250.799.705	0	0	-69.083	8.302.765	0
MKMINF20G762 - DO2013/29-1018DK 17.10.2018 0:0:0 - EUR	60.544.667	62.599.163	0	0	-17.242	2.071.737	0

MKMINF20G770 - DO2013/30-1018DK 31.10.2018 0:0:0 - EUR	80.587.241	83.321.200	0	0	-22.948	2.756.908	0
MKMINF20G788 - DO2013/31-1118DK 21.11.2018 0:0:0 - EUR	140.650.268	145.422.040	0	0	-40.052	4.811.824	0
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	90.243.630	93.304.944	0	0	-25.697	3.087.011	0
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	99.778.902	103.163.463	0	0	-28.412	3.412.974	0
MKMINF20G838 - DO2014/01-0119DK 23.1.2019 0:0:0 - EUR	99.429.600	102.816.848	0	0	-27.215	3.414.464	0
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	44.524.228	46.050.842	0	0	-11.627	1.538.241	0
MKMINF20G903 - DO2014/08-0319DK 27.3.2019 0:0:0 - EUR	29.567.891	30.590.480	0	0	-3.827	1.026.416	0
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	147.191.583	152.305.741	0	0	-28.297	5.142.454	0
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	88.333.382	91.415.167	0	0	-10.812	3.092.597	0
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	293.074.543	303.343.804	0	0	-36.175	10.305.436	0
MKMINF20G960 - DO2014/14-0619DK 19.6.2019 0:0:0 - EUR	58.510.491	60.564.675	0	0	-7.216	2.061.400	0

MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	209.972.477	217.875.195	0	0	-52.268	7.954.986	0
MKMINF20GA06 - DO2014/18-0824DK 21.8.2024 0:0:0 - EUR	72.869.320	75.643.635	0	0	-20.616	2.794.931	0
MKMINF20GA14 - DO2014/19-0924DK 4.9.2024 0:0:0 - EUR	48.293.505	50.167.939	0	0	-5.679	1.880.113	0
MKMINF20GA30 - DO2014/21-1017DK 2.10.2017 0:0:0 - EUR	50.340.626	51.535.591	0	0	-13.282	1.208.247	0
MKMINF20GA89 - DO2014/26-1019DK 16.10.2019 0:0:0 - EUR	333.020.211	341.705.133	0	0	-89.464	8.774.386	0
MKMINF20GC79 - DO2015/05-0230DK 12.2.2030 0:0:0 - EUR	129.353.151	133.207.357	0	0	-23.498	3.877.704	0
MKMINF20GD03 - DO2015/08-0230DK 26.2.2030 0:0:0 - EUR	49.680.499	51.160.178	0	0	-12.674	1.492.353	0
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	257.197.416	264.872.232	0	0	-68.856	7.743.672	0
MKMINF20GD52 - DO2015/13-0330DK 26.3.2030 0:0:0 - EUR	59.236.747	61.015.539	0	0	-8.339	1.787.130	0
MKMINF20GD78 - DO2015/15-0430DK 16.4.2030 0:0:0 - EUR	167.671.621	172.700.562	0	0	-44.755	5.073.696	0
MKMINF20GD94 - DO2015/17-0530DK 7.5.2030 0:0:0 - EUR	88.642.491	91.320.066	0	0	-12.834	2.690.408	0
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	177.384.072	182.060.921	0	0	-33.649	4.710.498	0

MKMINF20GE36 - DO2015/21-0625DK 25.6.2025 0:0:0 - EUR	117.570.183	120.688.455	0	0	-17.109	3.135.382	0
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	185.889.240	190.819.658	0	0	-37.450	4.967.868	0
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	185.390.287	191.034.019	0	0	-37.003	5.680.735	0
MKMINF20GE93 - DO2015/27-0725DK 23.7.2025 0:0:0 - EUR	136.802.763	140.431.716	0	0	-32.725	3.661.678	0
MKMINF20GF27 - DO2015/30-0825DK 6.8.2025 0:0:0 - EUR	68.490.803	70.309.061	0	0	-17.928	1.836.186	0
MKMINF20GF76 - DO2015/35-0825DK 27.8.2025 0:0:0 - EUR	117.243.018	120.370.343	0	0	-24.638	3.151.963	0
MKMINF20GG34 - DO2015/41-1030DK 29.10.2030 0:0:0 - EUR	271.066.089	279.067.087	0	0	-74.734	8.075.733	0
MKMINF20GH09 - DO2016/02-0131DK 14.1.2031 0:0:0 - EUR	99.704.140	102.653.201	0	0	-26.639	2.975.701	0
MKMINF20GH17 - DO2016/03-0131DK 22.1.2031 0:0:0 - EUR	149.132.696	153.882.863	0	0	-40.255	4.790.423	0
MKMINF20GH74 - DO2016/07-0231DK 11.2.2031 0:0:0 - EUR	69.422.618	71.647.306	0	0	-12.437	2.237.126	0
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	118.523.617	122.333.309	0	0	-31.000	3.840.692	0
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	147.881.807	152.666.402	0	0	-19.234	4.803.829	0

MKMINF20GI24 - DO2016/12-0431DK 14.4.2031 0:0:0 - EUR	83.720.588	86.423.951	0	0	-21.712	2.725.075	0
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	78.212.561	80.771.206	0	0	-10.292	2.568.937	0
MKMINF20GI81 - DO2016/18-0826DK 18.8.2026 0:0:0 - EUR	136.720.458	140.572.797	0	0	-36.289	3.888.628	0
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	136.183.750	140.669.131	0	0	-37.305	4.522.687	0
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	135.551.521	140.052.473	0	0	-27.679	4.528.631	0
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	338.666.505	349.897.110	0	0	-96.768	11.327.373	0
MKMINF20GJ64 - DO2016/26-1131DK 3.11.2031 0:0:0 - EUR	271.417.586	280.034.593	0	0	-76.075	8.693.082	0
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	269.374.072	277.926.197	0	0	-75.502	8.627.628	0
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	717.348.259	740.124.126	0	0	-201.067	22.976.935	0
MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	444.506.016	451.418.813	0	0	-801.573	7.714.370	0
MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	199.761.501	204.689.022	0	0	-181.707	5.109.228	0
MKMINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	439.931.500	449.602.864	0	0	-608.035	10.279.399	0

MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	150.011.500	153.116.846	0	0	-73.160	3.178.506	0
MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	150.011.500	152.581.308	0	0	-383.595	2.953.403	0
MKMINF20GL11 - DO2017/12-0432DK 6.4.2032 0:0:0 - EUR	190.011.501	192.761.034	0	0	-710.381	3.459.914	0
MKMINF20GL37 - DO2017/14-0532DK 4.5.2032 0:0:0 - EUR	89.011.500	90.158.747	0	0	-216.932	1.364.179	0
MKMINF20GL52 - DO2017/16-0632DK 8.6.2032 0:0:0 - EUR	122.771.500	123.751.630	0	0	-454.803	1.434.933	0
MKMINF20GL60 - DO2017/17-0632DK 22.6.2032 0:0:0 - EUR	136.031.500	136.921.689	0	0	-503.221	1.393.410	0
MKMINF20GL78 - DO2017/18-0632DK 29.6.2032 0:0:0 - EUR	142.051.500	142.879.650	0	0	-524.427	1.352.577	0
MKMINF20GL86 - DO2017/19-0732DK 6.7.2032 0:0:0 - EUR	150.011.500	150.782.680	0	0	-549.068	1.320.248	0
MKMINF20GL94 - DO2017/20-0732DK 20.7.2032 0:0:0 - EUR	100.011.500	100.616.363	0	0	-133.204	738.067	0
MKMINF20GM02 - DO2017/21-0822DK 10.8.2022 0:0:0 - EUR	400.011.501	401.216.672	0	0	-178.522	1.383.694	0
MKMINF20GM10 - DO2017/22-0832DK 10.8.2032 0:0:0 - EUR	800.011.501	803.835.221	0	0	-360.002	4.183.721	0
MKMINF20GM28 - DO2017/23-0822DK 17.8.2022 0:0:0 - EUR	80.011.500	80.213.842	0	0	-36.212	238.554	0

	МКMINF20GM36 - DO2017/24-0832DK 17.8.2032 0:0:0 - EUR	400.011.500	401.633.550	0	0	-182.479	1.804.529	0
	МКMINF20GM77 - DO2017/27-0932DK 21.9.2032 0:0:0 - EUR	180.011.500	179.629.043	0	0	-547.550	165.093	0
	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	382.196.610	357.012.018	11.103.006	0	-40.201.034	3.913.436	0
	US912810RU43 - T 2 7/8 11/15/46 15.11.2046 0:0:0 - USD	166.035.158	158.318.580	6.551.493	0	-16.196.118	1.928.047	0
	US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	216.161.451	198.693.438	4.551.513	0	-24.004.917	1.985.390	0
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	3.322.228.998	3.440.852.926	0	118.623.928	0	0	0
	DE0002635307 - ISHARES STOXX EUROPE 600 UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	198.687.889	195.829.672	0	-2.858.217	0	0	0
	DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	408.767.419	452.716.148	0	43.948.729	0	0	0
	US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA	138.630.905	166.859.784	0	28.228.879	0	0	0

	BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ							
	US4642865095 - ISHARES MSCI CANADA ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	153.215.740	157.185.620	0	3.969.880	0	0	0
	US4642865251 - ISHARES EDGE MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	265.113.275	265.239.821	0	126.546	0	0	0
	US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	189.034.068	210.738.018	0	21.703.950	0	0	0
	US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	62.807.333	71.356.198	0	8.548.866	0	0	0
	US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	61.511.555	56.806.669	0	-4.704.887	0	0	0

US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	219.351.433	249.653.279	0	30.301.846	0	0	0
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	173.476.327	139.533.843	0	-33.942.484	0	0	0
US46429B6065 - ISHARES MSCI POLAND CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	23.778.379	31.067.245	0	7.288.866	0	0	0
US46434G8226 - ISHARES MSCI JAPAN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	444.146.424	449.004.632	0	4.858.209	0	0	0
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX- US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	208.492.504	223.583.694	0	15.091.191	0	0	0
US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	50.004.646	46.621.173	0	-3.383.473	0	0	0
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	725.211.101	724.657.129	0	-553.972	0	0	0

	ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	21.818.333.801	22.646.756.126	10.703.206	478.980.511	-48.617.233	387.355.842	0
--	------------------------------------------------------	-----------------------	-----------------------	-------------------	--------------------	--------------------	--------------------	----------

Забелешка: Вкупната разлика помеѓу објективната (фер) вредност и трошокот на набавка е еднаква вкупно нерезализираните 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 12месеци	од 1-5 години	над 5 год	Некаматносни	Фиксни каматни стапки	Вкупно
Средства							
1) Пари и депозити кај банки	4.518.601	0	0	0	0	0	4.518.601
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	7.646.162.413	1.187.258	7.647.349.671
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	10.341.753.205	10.341.753.205
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	92.746.048	326.313.406	1.289.000.000	0	0	5.743.174.264	7.451.233.717
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	54.834.198	0	54.834.198
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	97.264.649	326.313.406	1.289.000.000	0	7.700.996.611	16.086.114.727	25.499.689.392
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	10.909.198	0	10.909.198
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	10.909.198	0	10.909.198
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	97.264.649	326.313.406	1.289.000.000	0	7.690.087.413	16.086.114.727	25.488.780.194

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	6,01	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти расположливи за продавање	4,09	4,21	2,56	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	3,25	4,08	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	4.518.601	0	0	0	4.518.601
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	7.647.349.671	0	0	0	7.647.349.671
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	10.341.753.205	0	0	0	10.341.753.205
4) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	313.068.007	708.578.351	1.859.000.000	4.570.587.359	7.451.233.717
5) Останати средства на пензискиот фонд	54.834.198	0	0	0	54.834.198
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	18.361.523.682	708.578.351	1.859.000.000	4.570.587.359	25.499.689.392
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	10.909.198	0	0	0	10.909.198
8) Вкупно обврски (6+7)	10.909.198	0	0	0	10.909.198
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	18.350.614.484	708.578.351	1.859.000.000	4.570.587.359	25.488.780.194
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	18.350.614.484	19.059.192.835	20.918.192.835	25.488.780.194	

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	1.617.080	0	2.901.521	0	0	4.518.601
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	1.173.321.838	1.840.299.869	4.467.321.672	0	166.406.292	7.647.349.671
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	571.473.580	9.413.267.608	357.012.018	0	0	10.341.753.205
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	2.569.519.464	4.846.341.645	0	0	35.372.608	7.451.233.717
5) Останати средства на пензискиот фонд	51.929.568	0	2.904.630	0	0	54.834.198
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	4.367.861.530	16.099.909.122	4.830.139.841	0	201.778.900	25.499.689.392
Обврски	9.151.889	0	1.757.309	0	0	10.909.198

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