



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен доброволен пензиски фонд НЛБ Пензија Плус

За првите девет месеци од 2017 година



NLB

Нов пензиски фонд

Содржина

1. Извештај за нето средствата на ОДПФ НЛБ Пензија Плус на ден 30.09.2017	3
2. Извештај за работењето на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01.-30.09.2017	5
3. Извештај за промените на нето средствата на ОДПФ НЛБ Пензија Плус 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 ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01-30.09.2017	9
6. Извештај за структурата на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус на ден 30.09.2017	10
7. Структура на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус по видови на финансиски средства на ден 30.09.2017	21
8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 30.09.2017	22
9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 30.09.2017	24

1. Извештај за нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија Плус 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	1.419	916
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		36	88
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ		0	0
5	14	Побарувања од други пензиски фондови		0	402
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)	4	402.520	547.655
12	3	Финансиски средства кои се чуваат за тргување		163.338	226.875
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		159.769	209.519
14	5	Финансиски средства кои се чуваат до достасување		79.413	111.261
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		403.975	549.061
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		2.319	0
19	23	Обврски за пренос на средства на други пензиски фондови по основ на промена на членство		0	9
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	418	557
23	27	Обврски за брокерски и посреднички провизии		0	0
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		31	42
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		2.768	608
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		401.207	548.453
28		Број на издадени сметководствени единици		2.685.627,555235	3.344.379,481556
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		149,390234	163,992478
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		367.630	485.314
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		1.039	1.916
32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-20.639	-34.123
33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-409	-2.164
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		6.800	28.824
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		47.348	68.737
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	6	-562	-51
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		401.207	548.453

2. Извештај за работењето на ОДФП НЛБ Пензија Плус 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	7	6.121	8.330
2	71	Приходи од дивиденди	8	3.364	4.199
3	73	Реализирани капитални добивки	9	198	1.139
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		1.039	480
5	75	Други неспоменати приходи		0	0
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		10.722	14.148
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	10	3.277	4.533
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	11	256	82
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		899	638
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	12	39	47
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		1	0
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		4.472	5.300
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		6.250	8.848
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	13	940	21.079
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		-390	-1.103
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		550	19.976
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		6.800	28.824

3. Извештај за промените на нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија
Плус 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 СРЕДСТАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
1	Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	6.250	8.848
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	550	19.976
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	-1.313	690
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	5.487	29.514
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	63.367	73.261
6	91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	1.038	863
7	92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-6.838	-12.645
8	93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	0	-1.615
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	57.567	59.864
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТАТА (4+9)	63.054	89.378
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	338.153	459.075
12		На крајот на периодот (10+11)	401.207	548.453
		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	433.033,591110	458.410,657335

14		Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	7.119,988498	5.371,453033
15		Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-46.534,425666	-79.188,365122
16		Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	0,000000	-10.074,533531
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	393.619,153942	374.519,211715

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	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	401.207	548.453
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	2.685.627,555235	3.344.379,481556
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	149,390234	163,992478
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,008987	0,008990
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,016939	0,017367
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	5,69%	6,63%

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

368.976

509.463

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 30.09.2010 - 30.09.2017 сведена на годишно ниво изнесува 4,98%, додека за периодот 30.09.2009-30.09.2016 изнесува 3,94%.

**5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОДФФ НЛБ
Пензија Плус за периодот 01.01-30.09.2017**

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	391.079
2	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	458.410,657335	73.261
3	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство во текот на периодот	5.371,453033	863
4	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-79.188,365122	-12.645
5	Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-10.074,533531	-1.615
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	3.344.379,481556	450.943
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		154,578083
	На крајот на периодот		163,992478

6. Извештај за структурата на инвестициите на ОДФ НЛБ Пензија Плус 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	1.232	5.387	6.636.956	7.538	9.286.680	0,09%	1,69%
МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	16	42.000	672.000	53.108	849.728	0,09%	0,15%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.443	580	8.376.940	850	12.276.550	0,47%	2,24%
МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	25.655	258	6.626.459	280	7.178.012	0,03%	1,31%
МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.641	3.699	9.768.436	4.899	12.938.259	0,58%	2,36%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.200	3.812	4.574.400	5.800	6.960.000	0,27%	1,27%
МКRPIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	268	34.500	9.246.000	38.000	10.184.000	0,67%	1,85%
МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	180	43.111	7.759.993	52.000	9.360.000	0,69%	1,70%
МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	501	8.755	4.386.255	7.920	3.967.920	0,65%	0,72%
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.346	2.300	3.095.800	3.248	4.371.808	0,50%	0,80%

Приоритетни акции								
Акции во затворени инвестициони фондови								
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			61.143.240		77.372.958		14,09%	
Обични акции								
BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	228	6.182	1.409.481	6.227	1.419.690	0,00%	0,26%	
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	644	4.242	2.732.012	4.448	2.864.298	0,00%	0,52%	
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	417	4.182	1.743.953	4.351	1.814.407	0,00%	0,33%	
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	611	5.456	3.333.895	5.276	3.223.513	0,00%	0,59%	
DE0007164600 - SAP SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	325	5.614	1.824.413	5.697	1.851.677	0,00%	0,34%	
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	412	7.188	2.961.365	7.327	3.018.718	0,00%	0,55%	
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	258	9.773	2.521.398	11.676	3.012.368	0,00%	0,55%	
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	435	5.429	2.361.791	5.535	2.407.542	0,00%	0,44%	
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	229	4.728	1.082.690	5.164	1.182.539	0,00%	0,22%	
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.751	1.460	2.556.758	1.573	2.754.264	0,00%	0,50%	

FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	220	11.153	2.453.592	14.350	3.156.935	0,00%	0,58%
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	710	3.686	2.617.398	4.195	2.978.586	0,00%	0,54%
GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.780	1.498	2.666.212	1.572	2.797.691	0,00%	0,51%
NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	629	4.448	2.798.036	4.943	3.108.922	0,00%	0,57%
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	40	46.614	1.864.550	50.697	2.027.873	0,00%	0,37%
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	41	48.334	1.981.675	50.053	2.052.164	0,00%	0,37%
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	230	8.528	1.961.398	9.708	2.232.734	0,00%	0,41%
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	393	6.755	2.654.831	8.024	3.153.539	0,00%	0,57%
US09062X1037 - BIOGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	141	16.540	2.332.144	16.303	2.298.670	0,00%	0,42%
US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	318	6.103	1.940.608	6.118	1.945.412	0,00%	0,35%
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	690	2.418	1.668.549	2.343	1.616.981	0,00%	0,29%
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.075	1.692	1.819.118	1.259	1.353.354	0,00%	0,25%
US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	300	3.155	946.453	2.397	718.967	0,00%	0,13%
US4370761029 - THE HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	196	7.820	1.532.783	8.516	1.669.090	0,00%	0,30%
US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	245	7.220	1.768.917	7.380	1.808.028	0,00%	0,33%
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	642	4.959	3.183.432	4.973	3.192.498	0,00%	0,58%

US5184391044 - THE ESTEE LAUDER COMPANIES INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	345	4.461	1.539.162	5.615	1.937.072	0,00%	0,35%
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	690	3.624	2.500.812	3.878	2.676.047	0,00%	0,49%
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	395	6.755	2.668.124	7.017	2.771.641	0,00%	0,50%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	661	3.238	2.140.482	2.796	1.848.431	0,00%	0,34%
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	820	3.113	2.553.014	2.577	2.112.895	0,00%	0,38%
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	898	3.098	2.781.724	2.871	2.578.508	0,00%	0,47%
Приоритетни акции							
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	21	45.017	945.357	49.936	1.048.659	0,00%	0,19%
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			71.846.128		74.633.716		13,59%
Вкупно вложувања во акции			132.989.367		152.006.674		27,68%

(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	10.176.808	4,00%	1,85%
МКМИНФ200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	10.753	621.349	661.238	0,36%	0,12%
МКМИНФ200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	31.881	1.860.863	1.882.019	0,69%	0,34%
МКМИНФ200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	239.821	13.887.084	14.558.304	2,66%	2,65%
МКМИНФ200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	38.216	2.202.603	2.259.057	0,87%	0,41%
МКМИНФ200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	61.527	3.522.951	3.667.672	1,23%	0,67%
МКМИНФ200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	42.122	2.410.352	2.497.951	0,54%	0,45%
МКМИНФ200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	234.380	13.308.308	13.782.817	3,35%	2,51%
МКМИНФ200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	386.768	21.831.940	22.744.098	5,09%	4,14%
МКМИНФ200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	230.606	12.996.624	13.206.537	2,14%	2,41%
МКМИНФ20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	97.549	6.075.891	6.322.232	4,76%	1,15%
МКМИНФ20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	16.260	1.008.609	1.049.502	0,32%	0,19%

MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	48.785	3.016.426	3.138.725	0,59%	0,57%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	65.033	4.043.000	4.180.131	0,92%	0,76%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	48.763	3.008.155	3.110.186	2,02%	0,57%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	19.460	1.197.354	1.237.966	0,39%	0,23%
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	64.846	3.957.750	4.093.435	1,40%	0,75%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	97.274	5.887.861	6.092.366	2,73%	1,11%
MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	102.137	6.680.682	6.868.628	6,67%	1,25%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	64.975	3.925.984	4.062.935	2,50%	0,74%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	81.066	4.885.046	5.056.061	1,18%	0,92%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	97.498	5.825.594	6.049.121	2,33%	1,10%
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	64.861	3.957.483	4.075.530	0,49%	0,74%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	81.242	4.927.790	5.057.667	2,47%	0,92%
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	64.834	3.913.861	4.017.628	2,06%	0,73%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	64.834	3.903.381	4.022.178	0,64%	0,73%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	24.313	1.481.545	1.529.166	1,17%	0,28%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	24.314	1.478.880	1.526.724	0,93%	0,28%
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	162.092	9.776.570	10.096.401	5,24%	1,84%
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	48.787	2.918.303	3.014.416	1,95%	0,55%

MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	56.906	3.389.425	3.501.924	1,17%	0,64%
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	65.047	3.871.406	3.999.720	0,85%	0,73%
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	58.227	3.593.261	3.707.285	0,77%	0,68%
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	129.460	7.969.775	8.222.678	0,91%	1,50%
MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	48.459	2.980.805	3.066.243	0,43%	0,56%
MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	24.545	1.510.408	1.547.646	0,26%	0,28%
MKMINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	23.883	1.470.397	1.502.703	0,21%	0,27%
MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	32.523	2.000.540	2.041.934	0,34%	0,37%
MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	32.456	2.000.540	2.034.793	0,44%	0,37%
MKMINF20GL11 - DO2017/12-0432DK 6.4.2032 0:0:0 - EUR	113.459	7.001.890	7.103.148	3,08%	1,29%
MKMINF20GL52 - DO2017/16-0632DK 8.6.2032 0:0:0 - EUR	205.041	12.653.416	12.754.373	4,22%	2,32%
MKMINF20GL60 - DO2017/17-0632DK 22.6.2032 0:0:0 - EUR	198.557	12.253.308	12.333.440	3,55%	2,25%
MKMINF20GL78 - DO2017/18-0632DK 29.6.2032 0:0:0 - EUR	127.888	7.892.130	7.938.108	0,88%	1,45%
MKMINF20GL86 - DO2017/19-0732DK 6.7.2032 0:0:0 - EUR	48.628	3.000.810	3.016.225	0,65%	0,55%
MKMINF20GL94 - DO2017/20-0732DK 20.7.2032 0:0:0 - EUR	48.741	3.000.810	3.018.951	2,59%	0,55%
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		239.081.214	245.826.670		44,77%
Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки					
US912810RU43 - Т 2 7/8 11/15/46 15.11.2046 0:0:0 - USD	80.000	4.427.605	4.221.829	0,00%	0,77%
US912828R366 - Т 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	82.000	4.439.368	4.073.215	0,00%	0,74%
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		8.866.973	8.295.044		1,51%
Вкупно инвестиции во обврзници		247.948.187	254.121.714		46,28%

(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	2.140	5.103.862	5.024.886	0,00%	0,92%
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО	1.169	7.260.169	8.016.984	0,00%	1,46%

ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ					
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	530	2.961.218	3.419.787	0,01%	0,62%
US4642865095 - ISHARES MSCI CANADA ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.650	3.907.244	3.992.925	0,00%	0,73%
US4642865251 - ISHARES EDGE MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.730	7.326.613	7.330.110	0,00%	1,34%
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.700	4.550.199	5.043.859	0,02%	0,92%
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	600	927.730	1.054.006	0,00%	0,19%
US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	970	1.498.133	1.637.817	0,00%	0,30%
US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	200	1.366.923	1.262.370	0,00%	0,23%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	632	4.117.450	4.684.705	0,01%	0,85%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.180	2.858.967	2.299.580	0,00%	0,42%
US46429B6065 - ISHARES MSCI POLAND CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	555	586.533	766.325	0,00%	0,14%
US46434G8226 - ISHARES MSCI JAPAN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.796	10.876.407	11.010.475	0,00%	2,01%

US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.150	1.502.213	1.374.727	0,00%	0,25%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.494	17.963.583	17.949.726	0,00%	3,27%
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		72.807.245	74.868.283		13,64%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		72.807.245	74.868.283		13,64%

(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	7.028.096	7.033.202	1,28%
Долгорочни депозити	59.400.000	59.625.698	10,86%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	66.428.096	66.658.900	12,14%

7. Структура на инвестициите на ОДФ НЛБ Пензија Плус 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	152.006.674	27,68%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	254.121.714	46,28%
Краткорочни хартии од вредност	0	0,00%
Акции и удели во инвестициони фондови	74.868.283	13,64%
Парични средства	916.465	0,17%
Пласмани и депозити	66.658.900	12,14%
Останати средства	489.471	0,09%
Вкупно средства	549.061.507	100,00%

8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОДФ НЛБ Пензија Плус 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	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	1.090	5.296.913	5.535.120	238.207
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
12.9.2017	US09075E1001 - BIVV	70	180.028	203.855	23.827
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				1.057.305

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

9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОДФ НЛБ Пензија Плус 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	61.143.240	77.372.958	0	16.229.718	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.636.956	9.286.680	0	2.649.724	0	0	0
	МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	672.000	849.728	0	177.728	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.376.940	12.276.550	0	3.899.610	0	0	0
	МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.626.459	7.178.012	0	551.553	0	0	0
	МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.768.436	12.938.259	0	3.169.823	0	0	0
	МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	4.574.400	6.960.000	0	2.385.600	0	0	0
	МКРРIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.246.000	10.184.000	0	938.000	0	0	0

	МКРЕРЛ101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.759.993	9.360.000	0	1.600.007	0	0	0
	МКВИТА101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	4.386.255	3.967.920	0	-418.335	0	0	0
	МКВВТК101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.095.800	4.371.808	0	1.276.008	0	0	0
	Обични акции издадени од странски компании и банки	70.900.770	73.585.056	0	2.684.286	0	0	0
	BE0974293251 - ANHEUSER- BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.409.481	1.419.690	0	10.208	0	0	0
	CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.732.012	2.864.298	0	132.286	0	0	0
	CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.743.953	1.814.407	0	70.454	0	0	0
	DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.333.895	3.223.513	0	-110.382	0	0	0
	DE0007164600 - SAP SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.824.413	1.851.677	0	27.264	0	0	0
	DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.961.365	3.018.718	0	57.353	0	0	0
	DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.521.398	3.012.368	0	490.971	0	0	0
	DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.361.791	2.407.542	0	45.751	0	0	0
	FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.082.690	1.182.539	0	99.849	0	0	0
	FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.556.758	2.754.264	0	197.505	0	0	0
	FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.453.592	3.156.935	0	703.343	0	0	0

	FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.617.398	2.978.586	0	361.187	0	0	0
	GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.666.212	2.797.691	0	131.479	0	0	0
	NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.798.036	3.108.922	0	310.885	0	0	0
	US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.864.550	2.027.873	0	163.324	0	0	0
	US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.981.675	2.052.164	0	70.489	0	0	0
	US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.961.398	2.232.734	0	271.336	0	0	0
	US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.654.831	3.153.539	0	498.709	0	0	0
	US09062X1037 - BIOGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.332.144	2.298.670	0	-33.474	0	0	0
	US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.940.608	1.945.412	0	4.804	0	0	0
	US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.668.549	1.616.981	0	-51.569	0	0	0
	US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.819.118	1.353.354	0	-465.764	0	0	0
	US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	946.453	718.967	0	-227.486	0	0	0
	US4370761029 - THE HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.532.783	1.669.090	0	136.307	0	0	0
	US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.768.917	1.808.028	0	39.112	0	0	0

US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.183.432	3.192.498	0	9.066	0	0	0
US5184391044 - THE ESTEE LAUDER COMPANIES INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.539.162	1.937.072	0	397.909	0	0	0
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.500.812	2.676.047	0	175.235	0	0	0
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.668.124	2.771.641	0	103.517	0	0	0
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.140.482	1.848.431	0	-292.051	0	0	0
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.553.014	2.112.895	0	-440.118	0	0	0
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.781.724	2.578.508	0	-203.215	0	0	0
Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	945.357	1.048.659	0	103.302	0	0	0
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	945.357	1.048.659	0	103.302	0	0	0
Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	239.081.214	245.826.670	381.645	0	-156.093	6.519.903	0
МКМИНФ20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	9.980.055	10.176.808	0	0	0	196.753	0
МКМИНФ200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	621.349	661.238	9.851	0	2.200	27.838	0
МКМИНФ200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	1.860.863	1.882.019	-53.169	0	3.056	71.269	0

	MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	13.887.084	14.558.304	153.274	0	14.463	503.482	0
	MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	2.202.603	2.259.057	-24.981	0	1.617	79.818	0
	MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	3.522.951	3.667.672	40.852	0	1.321	102.548	0
	MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	2.410.352	2.497.951	15.943	0	-93	71.749	0
	MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	13.308.308	13.782.817	112.382	0	2.523	359.604	0
	MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	21.831.940	22.744.098	306.457	0	4.325	601.376	0
	MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	12.996.624	13.206.537	-178.963	0	10.510	378.365	0
	MKMINF20G382 - DO2012/13- 1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	6.075.891	6.322.232	0	0	-1.813	248.154	0
	MKMINF20G408 - DO2012/15- 1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	1.008.609	1.049.502	0	0	-301	41.194	0
	MKMINF20G424 - DO2012/17- 1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	3.016.426	3.138.725	0	0	-900	123.198	0
	MKMINF20G754 - DO2013/28- 1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	4.043.000	4.180.131	0	0	-1.151	138.282	0
	MKMINF20G804 - DO2013/33- 1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	3.008.155	3.110.186	0	0	-857	102.887	0
	MKMINF20G820 - DO2013/35- 1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.197.354	1.237.966	0	0	-341	40.953	0
	MKMINF20G887 - DO2014/06- 0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	3.957.750	4.093.435	0	0	-1.033	136.719	0
	MKMINF20G911 - DO2014/09- 0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	5.887.861	6.092.366	0	0	-1.132	205.637	0
	MKMINF20G929 - DO2014/10- 0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	6.680.682	6.868.628	0	0	-1.190	189.136	0

MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	3.925.984	4.062.935	0	0	-481	137.432	0
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	4.885.046	5.056.061	0	0	-603	171.618	0
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	5.825.594	6.049.121	0	0	-1.457	224.984	0
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	3.957.483	4.075.530	0	0	-1.059	119.107	0
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	4.927.790	5.057.667	0	0	-935	130.812	0
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	3.913.861	4.017.628	0	0	-788	104.556	0
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	3.903.381	4.022.178	0	0	-779	119.576	0
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.481.545	1.529.166	0	0	-387	48.009	0
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	1.478.880	1.526.724	0	0	-192	48.036	0
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	9.776.570	10.096.401	0	0	-1.286	321.117	0
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	2.918.303	3.014.415	0	0	-799	96.912	0
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	3.389.425	3.501.924	0	0	-692	113.192	0
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	3.871.406	3.999.720	0	0	-1.106	129.421	0

MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	3.593.261	3.707.285	0	0	-1.007	115.031	0
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	7.969.775	8.222.678	0	0	-2.234	255.137	0
MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	2.980.805	3.066.243	0	0	-1.498	86.936	0
MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	1.510.408	1.547.646	0	0	-1.374	38.612	0
MKMINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	1.470.397	1.502.703	0	0	-2.032	34.338	0
MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	2.000.540	2.041.934	0	0	-976	42.369	0
MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	2.000.540	2.034.793	0	0	-5.116	39.369	0
MKMINF20GL11 - DO2017/12-0432DK 6.4.2032 0:0:0 - EUR	7.001.890	7.103.148	0	0	-26.177	127.435	0
MKMINF20GL52 - DO2017/16-0632DK 8.6.2032 0:0:0 - EUR	12.653.416	12.754.373	0	0	-46.874	147.831	0
MKMINF20GL60 - DO2017/17-0632DK 22.6.2032 0:0:0 - EUR	12.253.308	12.333.440	0	0	-45.329	125.461	0
MKMINF20GL78 - DO2017/18-0632DK 29.6.2032 0:0:0 - EUR	7.892.130	7.938.108	0	0	-29.136	75.114	0
MKMINF20GL86 - DO2017/19-0732DK 6.7.2032 0:0:0 - EUR	3.000.810	3.016.225	0	0	-10.983	26.398	0
MKMINF20GL94 - DO2017/20-0732DK 20.7.2032 0:0:0 - EUR	3.000.810	3.018.951	0	0	-3.997	22.138	0

	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	8.866.973	8.295.044	274.592	0	-935.873	89.353	0
	US912810RU43 - T 2 7/8 11/15/46 15.11.2046 0:0:0 - USD	4.427.605	4.221.829	174.706	0	-431.894	51.412	0
	US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	4.439.368	4.073.215	99.886	0	-503.979	37.940	0
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	72.807.245	74.868.283	0	2.061.038	0	0	0
	DE0002635307 - ISHARES STOXX EUROPE 600 UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	5.103.862	5.024.886	0	-78.976	0	0	0
	DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	7.260.169	8.016.984	0	756.815	0	0	0
	US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.961.218	3.419.787	0	458.568	0	0	0
	US4642865095 - ISHARES MSCI CANADA ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.907.244	3.992.925	0	85.681	0	0	0

US4642865251 - ISHARES EDGE MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	7.326.613	7.330.110	0	3.497	0	0	0
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	4.550.199	5.043.859	0	493.660	0	0	0
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	927.730	1.054.006	0	126.276	0	0	0
US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.498.133	1.637.817	0	139.684	0	0	0
US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.366.923	1.262.370	0	-104.553	0	0	0
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	4.117.450	4.684.705	0	567.256	0	0	0
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.858.967	2.299.580	0	-559.387	0	0	0

US46429B6065 - ISHARES MSCI POLAND CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	586.533	766.325	0	179.792	0	0	0
US46434G8226 - ISHARES MSCI JAPAN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	10.876.407	11.010.475	0	134.069	0	0	0
US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.502.213	1.374.727	0	-127.486	0	0	0
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	17.963.583	17.949.726	0	-13.857	0	0	0
ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	453.744.800	480.996.671	656.237	21.078.344	-1.091.966	6.609.256	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	916.465	0	0	0	0	0	916.465
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	226.874.957	0	226.874.957
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	209.519.087	209.519.087
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	33.453	4.632.876	39.000.000	0	0	67.595.197	111.261.526
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	489.471	0	489.471
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	949.918	4.632.876	39.000.000	0	227.364.427	277.114.284	549.061.506
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	608.427	0	608.427
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	608.427	0	608.427
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	949.918	4.632.876	39.000.000	0	226.756.001	277.114.284	548.453.079

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	3,93	2,60	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	3,23	4,20	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	916.465	0	0	0	916.465
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	226.874.957	0	0	0	226.874.957
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	209.519.087	0	0	0	209.519.087
4) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	305.782	14.086.619	53.000.000	43.869.125	111.261.526
5) Останати средства на пензискиот фонд	489.471	0	0	0	489.471
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	438.105.763	14.086.619	53.000.000	43.869.125	549.061.506
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0

7) Останати обврски	608.427	0	0	0	608.427
8) Вкупно обврски (6+7)	608.427	0	0	0	608.427
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	437.497.336	14.086.619	53.000.000	43.869.125	548.453.079
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	437.497.336	451.583.954	504.583.954	548.453.079	

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	846.189	0	70.276	0	0	916.465
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	77.372.958	43.954.315	100.868.979	0	4.678.705	226.874.957
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	10.176.808	191.047.235	8.295.044	0	0	209.519.087
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	66.080.791	44.673.666	0	0	507.069	111.261.526
5) Останати средства на пензискиот фонд	436.250	0	53.221	-	0	489.471
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	154.912.996	279.675.217	109.287.520	0	5.185.774	549.061.506
Обврски	571.184	0	37.243	0	0	608.427

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