



**Неревидирани основни финансиски извештаи за работењето на Отворен
задолжителен пензиски фонд НЛБ Пензиски фонд
за периодот од 1.1.2015 – 31.12.2015**

Образец бр.1

ИЗВЕШТАЈ ЗА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ОЗПФ НЛБ ПЕНЗИСКИ ФОНД

На ден 31.12.2015

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	31.12.2014 (во 000 ден.)	31.12.2015 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
1	10	Парични средства	3	2.574	32.845
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		9.961	701
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ	4	165.101	375.990
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 (ABP)		0	0
11		Вложувања во хартии од вредност и депозити (12+13+14)	5	15.158.454	18.215.690
12	3	Финансиски средства кои се чуваат за тргување		4.449.537	5.585.535
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		7.977.655	9.020.774
14	5	Финансиски средства кои се чуваат до достасување		2.731.262	3.609.381
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		15.336.090	18.625.226
16	20	Обврски за неконвертирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		0	27.575
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		0	16
19	23	Обврски за пренос на средства на други пензиски фондови по основ на промена на членство		22	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	12.609	19.617
23	27	Обврски за брокерски и посреднички провизии		0	0
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		1.378	15
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		14.009	47.223
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		15.322.081	18.578.003
28		Број на издадени сметководствени единици		95.325.767,281950	109.158.109,878653
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		160,733889	170,193521
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		12.181.739	14.520.873
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		47.783	50.384

32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-26.953	-37.642
33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-155.742	-166.552
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		864.224	937.761
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		2.395.902	3.260.126
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	7	15.128	13.053
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		15.322.081	18.578.003

Образец бр.2

ИЗВЕШТАЈ ЗА РАБОТЕЊЕТО НА ОЗПФ НЛБ ПЕНЗИСКИ ФОНД за периодот од 01.01 до 31.12.2015

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	31.12.2014 (во 000 ден.)	31.12.2015 (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	525.492	566.030
2	71	Приходи од дивиденди	9	89.729	110.342
3	73	Реализирани капитални добивки	10	84.182	128.093
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		29.753	76.383
5	75	Други неспоменати приходи	11	2.850	1.267
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		732.006	882.115
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	12	74.284	82.221
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	13	42.192	38.922
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		25.539	70.718
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	14	2.022	1.858
12	66	Загуба поради оштетување		353	0
13	69	Други расходи		39	1.421
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		144.429	195.140
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		587.577	686.975
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	15	280.286	242.205
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		-3.639	8.581
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		276.647	250.786
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		864.224	937.761

Образец бр.3

ИЗВЕШТАЈ ЗА ПРОМЕНИТЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ОЗПФ НЛБ ПЕНЗИСКИ ФОНД за периодот од 01.01 до 31.12.2015

Група на сметки	ПОЗИЦИЈА	31.12.2014 (во 000 ден.)	31.12.2015 (во 000 ден.)
2	3	4	5
	НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	587.577	686.975
Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	276.647	250.786
96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	1.508	-2.076
	ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	865.732	935.685
90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	2.035.658	2.339.134
91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	4.893	2.601
92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-8.215	-10.689
93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-23.816	-10.810
	ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	2.008.520	2.320.236
	ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	2.874.252	3.255.921
	НЕТО СРЕДСТВА		
	На почетокот на периодот	12.447.830	15.322.081
	На крајот на периодот (10+11)	15.322.081	18.578.003
	БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	13.132.929,601080	13.944.352,911463
	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	31.631,741141	15.477,366899
	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-53.740,668285	-63.611,550447
	Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-156.909,989229	-63.876,131212
	БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	12.953.910,684707	13.832.342,596703

Образец бр.4

ФИНАНСИСКИ ПОКАЗАТЕЛИ СПОРЕД СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ за периодот од 01.01 до 31.12.2015

Ознака на позиција	ПОЗИЦИЈА	31.12.2014 (во 000 ден.)	31.12.2015 (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	12.447.830	15.322.081
2	Број на сметководствени единици на почетокот на периодот	82.371.856,597243	95.325.767,281950
3	Вредност на сметководствената единица на почетокот на периодот (1/2)	151,117506	160,733889
	Вредноста на нето средствата на пензискиот фонд по сметководствена единица на крајот на периодот		
4	Нето средства на пензискиот фонд на крајот на периодот	15.322.081	18.578.003
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	95.325.767,281950	109.158.109,878653
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	160,733889	170,193521
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,005495	0,004873
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,042313	0,039812
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	4,83%	7,87%

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

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

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

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

Приносот прикажан за 2015 и 2014 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 6,45% за 2015, односно 2,67% за 2014 година.

13.886.574

17.255.480

Образец бр. 5

ИЗВЕШТАЈ ЗА БРОЈОТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ НА ОЗПФ НЛБ ПЕНЗИСКИ ФОНД за периодот од 01.01 до 31.12.2015

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	95.325.767,281950	12.046.827
2	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	13.944.352,911463	2.339.134
3	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство во текот на периодот	15.477,366899	2.601
4	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-63.611,550447	-10.689
5	Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-63.876,131212	-10.810
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	109.158.109,878653	14.367.063
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		160,733889
	На крајот на периодот		170,193521

Образец бр. 6

ИЗВЕШТАЈ ЗА СТРУКТУРАТА НА ИНВЕСТИЦИИТЕ НА ОЗПФ НЛБ ПЕНЗИСКИ ФОНД на ден 31.12.2015

(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	46.143	5.065	233.702.958	5.445	251.235.254	3,22%	1,35%
МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	561	55.500	31.135.500	37.830	21.222.630	3,12%	0,11%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	211.259	568	119.999.483	490	103.516.910	6,88%	0,56%
МККМBS101019 - КОМЕРЦИЈАЛНА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.546	1.952	12.775.566	2.295	15.025.296	0,29%	0,08%
МКМТСК101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	423.950	289	122.390.041	290	122.877.668	0,44%	0,66%
МКМТУР101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	39.107	3.868	151.247.840	3.850	150.561.950	8,65%	0,81%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.345	2.012	14.781.225	2.544	18.683.844	1,67%	0,10%
МКРРИV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.358	23.358	31.720.730	27.800	37.752.400	3,40%	0,20%
МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.646	55.058	90.625.704	41.000	67.486.000	6,33%	0,36%
МКТЕТЕ101016 - ТЕТЕКС АД ТЕТОВО - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.697	650	6.953.050	645	6.899.565	2,58%	0,04%
МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.517	8.889	13.484.798	8.989	13.636.707	1,97%	0,07%
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.010	1.055	6.340.550	2.600	15.626.000	2,23%	0,08%
МКЗРКО101012 - ЗК ПЕЛАГОНИЈА АД БИТОЛА - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.370	1.840	6.200.800	1.600	5.392.000	1,66%	0,03%

Приоритетни акции							
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			840.946.035		829.916.223		4,46%
Обични акции							
BE0003793107 - ANHEUSER-BUSCH INBEV NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	12.880	6.330	81.531.787	7.046	90.758.066	0,00%	0,49%
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.741	4.931	67.756.424	4.944	67.935.235	0,00%	0,36%
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.259	3.792	54.075.083	4.246	60.547.154	0,00%	0,33%
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.750	5.505	81.205.130	6.013	88.698.986	0,00%	0,48%
DE0006048408 - HENKEL AG & CO. KGAA ST - ОБИЧНИ АКЦИИ	12.500	5.046	63.076.057	5.459	68.231.529	0,00%	0,37%
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	16.360	5.663	92.640.097	5.536	90.571.114	0,00%	0,49%
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.671	8.481	73.537.133	10.074	87.350.034	0,00%	0,47%
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	17.870	4.324	77.274.067	4.356	77.841.312	0,00%	0,42%
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	17.056	4.882	83.271.449	4.841	82.573.953	0,00%	0,44%
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	57.608	1.284	73.958.082	1.554	89.524.807	0,00%	0,48%
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.199	8.946	73.351.234	8.925	73.176.666	0,00%	0,39%
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	27.510	3.207	88.216.872	3.217	88.502.178	0,00%	0,48%
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.610	26.758	43.079.948	43.860	70.614.354	0,00%	0,38%
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.550	8.798	75.223.602	9.151	78.243.242	0,00%	0,42%
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.912	5.927	82.454.872	5.934	82.553.382	0,00%	0,44%
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.375	21.921	73.982.933	17.270	58.287.254	0,00%	0,31%
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	24.350	2.162	52.636.137	2.422	58.971.907	0,00%	0,32%
US26875P1012 - EOG RESOURCES INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.400	4.490	46.697.420	3.991	41.503.735	0,00%	0,22%

US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	50.200	1.278	64.138.598	1.756	88.154.341	0,00%	0,47%
US4062161017 - HALLIBURTON COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	23.300	1.989	46.332.994	1.919	44.712.341	0,00%	0,24%
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.640	5.741	55.345.959	7.456	71.871.159	0,00%	0,39%
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	23.114	3.180	73.509.247	3.722	86.039.591	0,00%	0,46%
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	26.630	2.342	62.362.151	3.128	83.289.365	0,00%	0,45%
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	15.120	4.774	72.189.136	5.373	81.240.426	0,00%	0,44%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	21.580	2.985	64.422.468	3.384	73.030.070	0,00%	0,39%
US9078181081 - UNION PACIFIC CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	16.674	5.516	91.975.439	4.408	73.506.964	0,00%	0,39%
US9182041080 - V.F. CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	11.650	3.787	44.118.247	3.509	40.883.420	0,00%	0,22%
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.500	2.598	37.673.707	2.606	37.781.559	0,00%	0,20%
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	26.825	2.777	74.495.643	3.065	82.205.545	0,00%	0,44%
Приоритетни акции							
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	1.163	26.622	30.961.565	42.781	49.754.774	0,00%	0,27%
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			1.981.560.274		2.168.354.460		11,64%
Вкупно вложувања во акции			2.822.506.309		2.998.270.683		16,10%

(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					
MKMINF20G218 - DO2011/01-0916 29.9.2016 0:0:0 - MKD	200.000.000	191.474.927	202.840.243	38,68%	1,09%
MKMINF20G234 - DO2011/03-1216 19.12.2016 0:0:0 - MKD	735.000.000	682.133.185	736.278.673	58,78%	3,95%
MKMINF20G291 - DO2012/05-0817 9.8.2017 0:0:0 - MKD	1.045.000.000	1.008.093.728	1.068.028.823	88,71%	5,73%
MKMINF20G499 - DO2013/01-0118 9.1.2018 0:0:0 - MKD	185.000.000	184.748.846	195.095.751	100,00%	1,05%
MKMINF20G507 - DO2013/03-0118 24.1.2018 0:0:0 - MKD	60.000.000	59.795.832	62.999.175	100,00%	0,34%
MKMINF20GA71 - DO2014/25-1019 16.10.2019 0:0:0 - MKD	70.000.000	67.849.760	70.574.252	5,81%	0,38%
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	240.000.000	240.035.000	245.867.751	96,00%	1,32%
MKMINF200D50 - RMDEN05 31.5.2016 0:0:0 - EUR	240.314	13.892.749	14.864.119	7,07%	0,08%
MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	817.317	47.366.369	50.226.333	22,70%	0,27%
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	46.643	2.689.758	2.844.790	0,52%	0,02%
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	288.637	16.683.151	17.541.955	3,14%	0,09%
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	2.067.732	119.261.656	125.017.109	13,78%	0,67%
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	1.230	72.905	72.329	0,02%	0,00%
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	2.196	129.162	130.081	0,03%	0,00%
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	787.198	44.329.506	45.374.030	7,57%	0,24%
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	1.599.086	90.983.446	94.722.263	17,77%	0,51%
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	1.731.000	99.891.267	102.536.223	18,22%	0,55%
MKMINF20G226 - DO2011/02-0916-DK 29.9.2016 0:0:0 - EUR	2.438.782	143.746.488	152.276.333	41,58%	0,82%
MKMINF20G259 - DO2012/01-0317-DK 26.3.2017 0:0:0 - EUR	3.252.133	197.294.784	208.698.650	79,21%	1,12%
MKMINF20G267 - DO2012/02-0617-DK 25.6.2017 0:0:0 - EUR	1.136.017	67.950.813	71.934.140	6,06%	0,39%
MKMINF20G325 - DO2012/07-0817-DK 16.8.2017 0:0:0 - EUR	8.536.516	506.600.214	536.434.882	56,76%	2,88%

MKMINF20G341 - DO2012/09-0917-DK 6.9.2017 0:0:0 - EUR	1.804.834	106.763.487	113.077.445	30,58%	0,61%
MKMINF20G358 - DO2012/10-0917-DK 20.9.2017 0:0:0 - EUR	2.438.826	143.937.906	152.481.131	14,44%	0,82%
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017-DK 4.10.2017 0:0:0 - EUR	1.950.982	114.899.947	121.732.766	95,24%	0,65%
MKMINF20G390 - DO2012/14-1017-DK 18.10.2017 0:0:0 - EUR	1.951.128	114.661.391	121.492.547	92,66%	0,65%
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117-DK 1.11.2017 0:0:0 - EUR	1.951.178	114.417.845	121.246.887	38,19%	0,65%
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117-DK 23.11.2017 0:0:0 - EUR	6.862.391	401.018.228	425.023.448	83,51%	2,28%
MKMINF20G481 - DO2013/02-0118-DK 9.1.2018 0:0:0 - EUR	7.007.560	430.239.826	454.323.385	18,50%	2,44%
MKMINF20G523 - DO2013/05-0218-DK 28.2.2018 0:0:0 - EUR	973.762	59.370.815	62.563.855	11,17%	0,34%
MKMINF20G549 - DO2013/07-0318-DK 7.3.2018 0:0:0 - EUR	1.297.421	79.009.829	83.274.677	100,00%	0,45%
MKMINF20G556 - DO2013/08-0318-DK 14.3.2018 0:0:0 - EUR	1.459.066	88.760.370	93.559.858	84,91%	0,50%
MKMINF20G572 - DO2013/10-0418-DK 4.4.2018 0:0:0 - EUR	1.297.526	78.695.986	82.961.817	31,77%	0,45%
MKMINF20G580 - DO2013/11-0418-DK 25.4.2018 0:0:0 - EUR	973.394	58.909.297	61.954.500	35,29%	0,33%
MKMINF20G606 - DO2013/13-0518-DK 30.5.2018 0:0:0 - EUR	2.920.182	175.857.237	185.012.860	70,18%	0,99%
MKMINF20G671 - DO2013/20-0718DK 18.7.2018 0:0:0 - EUR	1.945.368	116.575.504	122.311.437	44,77%	0,66%
MKMINF20G705 - DO2013/23-0718DK 25.7.2018 0:0:0 - EUR	973.457	58.279.747	61.148.963	34,71%	0,33%
MKMINF20G721 - DO2013/25-0818DK 30.8.2018 0:0:0 - EUR	3.008.345	179.289.390	188.136.024	45,65%	1,01%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	3.901.963	231.489.422	242.996.446	55,22%	1,30%
MKMINF20G762 - DO2013/29-1018DK 17.10.2018 0:0:0 - EUR	975.589	57.777.445	60.652.860	46,86%	0,33%
MKMINF20G770 - DO2013/30-1018DK 31.10.2018 0:0:0 - EUR	1.300.760	76.900.226	80.732.023	53,69%	0,43%
MKMINF20G788 - DO2013/31-1118DK 21.11.2018 0:0:0 - EUR	2.276.116	134.206.024	140.902.782	57,38%	0,76%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	1.462.898	86.099.462	90.406.050	60,65%	0,49%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.621.644	95.185.637	99.958.737	32,11%	0,54%
MKMINF20G838 - DO2014/01-0119DK 23.1.2019 0:0:0 - EUR	1.621.771	99.433.622	104.204.966	25,41%	0,56%

MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	729.513	44.526.044	46.672.456	15,74%	0,25%
MKMINF20G903 - DO2014/08-0319DK 27.3.2019 0:0:0 - EUR	486.265	29.569.761	31.003.521	24,27%	0,17%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	2.431.844	147.198.609	154.358.758	68,34%	0,83%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	1.461.929	88.346.929	92.648.614	56,25%	0,50%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	4.863.947	293.066.025	307.420.714	70,96%	1,65%
MKMINF20G960 - DO2014/14-0619DK 19.6.2019 0:0:0 - EUR	972.763	58.510.921	61.380.546	32,17%	0,33%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	3.493.685	210.220.650	221.251.419	83,66%	1,19%
MKMINF20GA06 - DO2014/18-0824DK 21.8.2024 0:0:0 - EUR	1.219.685	72.926.487	76.784.935	12,51%	0,41%
MKMINF20GA14 - DO2014/19-0924DK 4.9.2024 0:0:0 - EUR	813.169	48.296.992	50.891.688	79,37%	0,27%
MKMINF20GA30 - DO2014/21-1017DK 2.10.2017 0:0:0 - EUR	810.985	50.314.366	50.516.147	12,77%	0,27%
MKMINF20GA89 - DO2014/26-1019DK 16.10.2019 0:0:0 - EUR	486.582	28.900.549	30.091.441	3,96%	0,16%
MKMINF20GC79 - DO2015/05-0230DK 12.2.2030 0:0:0 - EUR	2.113.649	130.035.000	134.803.125	61,90%	0,72%
MKMINF20GD03 - DO2015/08-0230DK 26.2.2030 0:0:0 - EUR	813.011	50.012.500	51.772.975	58,82%	0,28%
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	4.215.947	260.035.001	268.041.775	31,74%	1,44%
MKMINF20GD52 - DO2015/13-0330DK 26.3.2030 0:0:0 - EUR	972.578	60.012.500	61.746.034	18,78%	0,33%
MKMINF20GD78 - DO2015/15-0430DK 16.4.2030 0:0:0 - EUR	2.759.037	170.035.000	174.768.149	61,92%	0,94%
MKMINF20GD94 - DO2015/17-0530DK 7.5.2030 0:0:0 - EUR	1.462.088	90.027.000	92.414.056	35,94%	0,50%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	2.924.727	180.035.000	184.021.404	88,80%	0,99%
MKMINF20GE36 - DO2015/21-0625DK 25.6.2025 0:0:0 - EUR	1.945.052	120.035.000	121.989.773	0,00%	0,66%
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	3.079.626	190.035.000	192.874.173	97,94%	1,04%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	3.079.626	190.035.000	193.320.758	30,22%	1,04%
MKMINF20GE93 - DO2015/27-0725DK 23.7.2025 0:0:0 - EUR	2.269.287	140.035.000	141.945.062	200,00%	0,76%
MKMINF20GF27 - DO2015/30-0825DK 6.8.2025 0:0:0 - EUR	1.137.601	70.021.000	71.067.250	100,00%	0,38%
MKMINF20GF76 - DO2015/35-0825DK 27.8.2025 0:0:0 - EUR	1.951.457	120.035.000	121.668.231	88,89%	0,65%

МКMINF20GG34 - DO2015/41-1030DK 29.10.2030 0:0:0 - EUR	4.378.319	270.035.000	271.546.361	90,00%	1,46%
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		9.999.102.522	10.479.512.734		56,27%
Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки					
US912810RN00 - US TREASURY 30 15.8.2045 0:0:0 - USD	1.500.000	82.577.607	83.028.921	0,00%	0,45%
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		82.568.748	83.028.921		0,45%
Вкупно инвестиции во обврзници		10.081.664.033	10.562.541.656		56,71%

(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					
MKMINFDYF230 - DZ2015/23-364 1.12.2016 0:0:0 - MKD	100.000.000	97.564.500	97.749.722	2,65%	0,52%
MKMINFDYF248 - DZ2015/24-364 14.12.2016 0:0:0 - MKD	200.000.000	195.103.000	195.302.410	86,02%	1,05%
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		292.667.500	293.052.132		1,57%
Удели во отворени инвестициони фондови					13,87%
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	41.133	220.866.508	240.613.598	0,04%	1,29%
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	8.660	56.986.461	55.176.624	0,04%	0,30%

US4642862100 - ISHARES INTERNATIONAL HIGH YIELD BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	26.400	69.796.199	66.035.168	0,69%	0,35%
US4642865251 - ISHARES MSCI ALL COUNTRY WORLD MINIMUM VOLATILITY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	62.600	240.020.369	244.456.423	0,28%	1,31%
US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	52.719	68.210.192	71.952.168	0,43%	0,39%
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	79.559	128.419.386	130.874.952	0,74%	0,70%
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	52.620	92.607.770	83.860.720	0,12%	0,45%
US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	116.200	161.036.998	171.562.971	0,07%	0,92%
US4642868487 - ISHARES MSCI JAPAN ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	357.900	215.706.440	244.537.941	0,03%	1,31%
US4642868552 - ISHARES INC-MSCI ITALY CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	134.607	95.793.052	104.264.463	0,22%	0,56%
US4642872422 - ISHARES IBOX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	9.000	55.027.686	57.845.208	0,01%	0,31%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	33.822	162.096.004	186.265.030	0,40%	1,00%
US4642874659 - ISHARES MSCI EAFE ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	21.773	66.975.811	72.112.089	0,00%	0,39%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	83.600	190.147.346	159.578.789	0,32%	0,86%
US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	45.000	48.294.685	45.853.528	0,34%	0,25%
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	184.016	310.412.462	319.512.781	1,02%	1,72%
US78464A1512 - SPDR BARCLAYS INTERNATIONAL CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	30.600	54.614.203	53.131.745	0,38%	0,29%

US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	26.170	259.772.600	275.781.203	0,02%	1,48%
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		2.522.031.669	2.583.415.401		13,87%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		2.814.699.169	2.876.467.533		15,44%

(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	362.585.373	371.395.179	1,99%
Долгорочни депозити	1.383.611.632	1.407.014.345	7,55%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	1.746.197.005	1.778.409.524	9,55%

Образец бр. 7

СТРУКТУРА НА ИНВЕСТИЦИИТЕ НА ОЗПФ НЛБ ПЕНЗИСКИ ФОНД ПО ВИДОВИ НА ФИНАНСИСКИ СРЕДСТВА на ден 31.12.2015

ОПИС	Вкупна вредност на денот на известувањето (во денари)	Процентуален удел во вредноста на пензискиот фонд
Акции	2.998.270.683	16,10%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	10.562.541.656	56,71%
Краткорочни хартии од вредност	293.052.132	1,57%
Акции и удели во инвестициони фондови	2.583.415.401	13,87%
Парични средства	32.845.491	0,18%
Пласмани и депозити	1.778.409.524	9,55%
Останати средства	376.691.098	2,02%
Вкупно средства	18.625.225.987	100,00%

Образец бр. 8

ИЗВЕШТАЈ ЗА РЕАЛИЗИРАНИТЕ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ НА ОЗПФ НЛБ ПЕНЗИСКИ ФОНД

за

периодот од 1.1.2015 до 31.12.2015

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	1.000	5.087.790	5.500.000	412.210
20.02.2015	MKALKA101011 - ALK	750	3.815.843	4.125.000	309.158
27.02.2015	MKALKA101011 - ALK	250	1.271.948	1.375.000	103.053
	Обични акции издадени од странски компании и банки	6.868.891	616.836.951	625.577.301	8.740.350
23.11.2015	BE0003793107 - ABI	2.000	12.418.385	14.755.124	2.336.739
16.01.2015	CH0012005267 - NOVN	2.800	13.217.368	14.441.148	1.223.780
20.01.2015	CH0012005267 - NOVN	2.800	13.217.368	15.134.564	1.917.196
26.01.2015	CH0012005267 - NOVN	2.500	11.801.222	13.681.375	1.880.154
26.01.2015	DE0005190003 - BMW	2.000	11.038.371	12.889.813	1.851.443
06.07.2015	DE0005190003 - BMW	1.650	9.285.886	9.986.374	700.488
26.10.2015	DE0005190003 - BMW	2.000	11.010.865	11.520.928	510.063
06.07.2015	DE0007236101 - SIE	1.800	10.374.986	9.961.588	-413.399
26.01.2015	DE0007664005 - VOW	700	7.750.960	8.661.266	910.306
13.03.2015	DE0007664005 - VOW	500	5.536.400	7.310.739	1.774.339
22.09.2015	DE0007664005 - VOW	4.500	50.541.248	31.009.986	-19.531.262
23.09.2015	DE0007664005 - VOW	3.146	35.333.948	22.902.726	-12.431.222
01.04.2015	DE0008404005 - ALV	499	4.213.791	5.050.100	836.309
29.06.2015	DE0008404005 - ALV	4.400	37.387.728	38.688.160	1.300.432
06.07.2015	DE0008404005 - ALV	1.150	9.771.793	9.911.723	139.930
26.10.2015	DE0008404005 - ALV	700	5.936.569	6.812.613	876.044
16.01.2015	DE000BASF111 - BAS	2.000	8.592.640	8.844.807	252.167
20.01.2015	DE000BASF111 - BAS	2.000	8.592.640	9.114.490	521.850
22.01.2015	DE000BASF111 - BAS	2.000	8.592.640	9.220.304	627.663
06.07.2015	DE000BASF111 - BAS	2.000	8.592.640	9.682.350	1.089.710
13.01.2015	FR0000052292 - RMS	234	4.156.151	4.189.182	33.031
26.10.2015	FR0000120578 - SAN	1.100	5.375.499	6.252.121	876.622
26.01.2015	FR0000120628 - CS	7.000	8.265.252	8.916.497	651.245

29.06.2015	FR0000120628 - CS	28.169	33.260.555	39.662.483	6.401.928
06.07.2015	FR0000120628 - CS	7.150	8.442.365	9.726.790	1.284.425
02.04.2015	FR0000131104 - BNP	600	1.817.144	2.115.305	298.160
28.04.2015	FR0000131104 - BNP	2.000	6.057.148	7.139.649	1.082.502
29.06.2015	FR0000131104 - BNP	11.600	35.446.638	39.407.028	3.960.390
13.01.2015	US00287Y1091 - ABBV	4.500	14.889.027	15.404.282	515.256
05.02.2015	US00287Y1091 - ABBV	15.272	50.530.048	47.293.928	-3.236.120
06.03.2015	US46625H1005 - JPM	1.200	3.796.884	4.151.089	354.205
17.06.2015	US46625H1005 - JPM	1.200	3.796.884	4.520.599	723.715
28.04.2015	US5949181045 - MSFT	5.000	11.749.609	13.862.993	2.113.384
09.11.2015	US5949181045 - MSFT	4.000	9.367.203	12.407.569	3.040.366
16.12.2015	US7427181091 - PG	8.477	39.041.221	38.029.868	-1.011.352
18.03.2015	US7739031091 - ROK	2.500	14.055.791	16.532.081	2.476.289
20.03.2015	US7739031091 - ROK	2.500	14.055.791	16.772.378	2.716.587
07.04.2015	US7739031091 - ROK	1.320	7.421.458	8.469.795	1.048.337
16.04.2015	US7739031091 - ROK	1.320	7.421.458	8.758.568	1.337.110
25.06.2015	US98956P1021 - ZMH	8.370	54.683.377	52.384.917	-2.298.461
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	51.099	287.882.133	298.840.466	10.944.099
26.10.2015	MKMINF20G234 - DO2011/03-1216	26.500	277.803.521	288.096.638	10.279.105
30.09.2015	MKMINF20G291 - DO2012/05-0817	1.000	10.078.612	10.691.905	613.071
31.05.2015	MKMINF200D50 - RMDEN05	4.195	0	6.057	6.057
31.05.2015	MKMINF200D68 - PMДЕН06	8.658	0	17.291	17.291
31.05.2015	MKMINF200D76 - PMДЕН07	1.438	0	3.695	3.695
31.05.2015	MKMINF200D84 - PMДЕН08	9.307	0	24.880	24.880
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	322.395	641.907.925	710.981.989	69.074.064
29.06.2015	US4642867075 - EWQ	45.000	56.084.124	64.815.975	8.731.851
17.11.2015	US4642867075 - EWQ	15.000	19.407.669	21.682.042	2.274.373
19.11.2015	US4642867075 - EWQ	15.000	19.407.669	22.008.997	2.601.329
27.11.2015	US4642867075 - EWQ	13.000	16.819.979	19.001.007	2.181.027
31.03.2015	US4642867646 - EWP	3.100	5.427.811	6.145.955	718.144
06.07.2015	US4642867646 - EWP	27.000	47.518.240	48.505.255	987.015
31.03.2015	US4642868552 - EWI	18.500	12.720.997	15.588.378	2.867.381
29.06.2015	US4642868552 - EWI	31.157	21.579.561	26.031.103	4.451.542
06.07.2015	US4642868552 - EWI	73.000	50.560.322	57.839.668	7.279.347

08.01.2015	US4642872422 - LQD	11.000	66.411.591	68.461.846	2.050.255
03.02.2015	US4642872422 - LQD	5.000	30.187.087	33.402.589	3.215.502
02.04.2015	US4642872422 - LQD	2.200	13.282.318	15.363.996	2.081.678
06.04.2015	US4642872422 - LQD	4.400	26.564.636	30.071.932	3.507.295
22.09.2015	US4642872919 - IXN	4.000	19.170.481	19.829.493	659.012
25.09.2015	US4642872919 - IXN	4.000	19.170.481	20.065.517	895.036
26.01.2015	US4642875805 - IYC	3.500	24.372.894	26.381.234	2.008.341
09.03.2015	US4642875805 - IYC	1.700	11.838.263	13.750.692	1.912.429
16.03.2015	US4642875805 - IYC	2.000	13.927.368	16.933.925	3.006.557
18.03.2015	US4642875805 - IYC	1.700	11.838.263	14.234.879	2.396.616
20.03.2015	US4642875805 - IYC	1.700	11.838.263	14.465.684	2.627.421
22.09.2015	US4642875805 - IYC	4.300	29.943.841	33.293.203	3.349.363
25.09.2015	US4642875805 - IYC	3.800	26.461.999	29.406.740	2.944.741
05.10.2015	US4642875805 - IYC	4.838	33.690.303	37.890.523	4.200.221
16.01.2015	US78464A4177 - JNK	27.500	53.683.769	55.811.356	2.127.587

	Дополнителни реализирани капитални добивки/загуби			Реализирани загуби	Реализирани добивки
	Реализирани капитални добивки/загуби - наплата на достасани хартии од вредност и достасани анuitети на хартии од вредност	0	0	0	0
	ВКУПНО РЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ				89.170.723

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

Образец бр. 9

ИЗВЕШТАЈ ЗА НЕРЕАЛИЗИРАНИТЕ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ ЗА ОЗПФ НЛБ ПЕНЗИСКИ ФОНД за периодот од 1.1.2015 до 31.12.2015

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	841.358.245	829.916.223	0	-11.442.022	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	233.702.958	251.235.254	0	17.532.296	0	0	0
	МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	31.135.500	21.222.630	0	-9.912.870	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	119.999.483	103.516.910	0	-16.482.573	0	0	0
	МККМBS101019 - КОМЕРЦИЈАЛНА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	12.775.566	15.025.296	0	2.249.729	0	0	0
	МКМТСК101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	122.390.041	122.877.668	0	487.627	0	0	0
	МКМТУР101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	151.247.840	150.561.950	0	-685.890	0	0	0
	МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.781.225	18.683.844	0	3.902.619	0	0	0
	МКРРIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	31.720.730	37.752.400	0	6.031.670	0	0	0
	МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	90.625.704	67.486.000	0	-23.139.704	0	0	0
	МКТЕТЕ101016 - ТЕТЕКС АД ТЕТОВО - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.953.050	6.899.565	0	-53.485	0	0	0
	МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.484.798	13.636.707	0	151.909	0	0	0
	МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.340.550	15.626.000	0	9.285.450	0	0	0
	МКZRKO101012 - ЗК ПЕЛАГОНИЈА АД БИТОЛА - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.200.800	5.392.000	0	-808.800	0	0	0
	Приоритетни акции издадени во Република Македонија							
	Акции во затворени инвестициони фондови издадени во Република Македонија							
	Обични акции издадени од странски компании и банки	1.970.531.914	2.118.599.686	0	148.067.772	0	0	0
	BE0003793107 - ANHEUSER-BUSCH INBEV NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	81.531.787	90.758.066	0	9.226.279	0	0	0

	CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	67.756.424	67.935.235	0	178.811	0	0	0
	CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	54.075.083	60.547.154	0	6.472.071	0	0	0
	DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	81.205.130	88.698.986	0	7.493.856	0	0	0
	DE0006048408 - HENKEL AG & CO. KGAA ST - ОБИЧНИ АКЦИИ	63.076.057	68.231.529	0	5.155.472	0	0	0
	DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	92.640.097	90.571.114	0	-2.068.984	0	0	0
	DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.537.133	87.350.034	0	13.812.901	0	0	0
	DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	77.274.067	77.841.312	0	567.246	0	0	0
	FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	83.271.449	82.573.953	0	-697.496	0	0	0
	FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.958.082	89.524.807	0	15.566.725	0	0	0
	FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.351.234	73.176.666	0	-174.568	0	0	0
	FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	88.216.872	88.502.178	0	285.307	0	0	0
	US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	43.079.948	70.614.354	0	27.534.406	0	0	0
	US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	75.223.602	78.243.242	0	3.019.639	0	0	0
	US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	82.454.872	82.553.382	0	98.510	0	0	0
	US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.982.933	58.287.254	0	-15.695.680	0	0	0
	US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	52.636.137	58.971.907	0	6.335.770	0	0	0
	US26875P1012 - EOG RESOURCES INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	46.697.420	41.503.735	0	-5.193.685	0	0	0
	US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	64.138.598	88.154.341	0	24.015.743	0	0	0
	US4062161017 - HALLIBURTON COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	46.332.994	44.712.341	0	-1.620.654	0	0	0
	US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	55.345.959	71.871.159	0	16.525.200	0	0	0
	US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.509.247	86.039.591	0	12.530.345	0	0	0

	US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	62.362.151	83.289.365	0	20.927.214	0	0	0
	US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	72.189.136	81.240.426	0	9.051.291	0	0	0
	US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	64.422.468	73.030.070	0	8.607.602	0	0	0
	US9078181081 - UNION PACIFIC CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	91.975.439	73.506.964	0	-18.468.476	0	0	0
	US9182041080 - V.F. CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	44.118.247	40.883.420	0	-3.234.827	0	0	0
	US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	37.673.707	37.781.559	0	107.852	0	0	0
	US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	74.495.643	82.205.545	0	7.709.902	0	0	0
	Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	30.961.565	49.754.774	0	18.793.209	0	0	0
	US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	30.961.565	49.754.774	0	18.793.209	0	0	0
	Акции во затворени инвестициони фондови издадени од странски компании и банки							
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	9.999.102.522	10.479.512.735	-1.793.852	154.759	9.347.580	472.701.726	0
	MKMINF20G218 - DO2011/01-0916 29.9.2016 0:0:0 - MKD	191.474.927	202.840.243	0	0	0	11.365.315	0
	MKMINF20G234 - DO2011/03-1216 19.12.2016 0:0:0 - MKD	682.133.185	736.278.673	0	0	0	54.145.487	0
	MKMINF20G291 - DO2012/05-0817 9.8.2017 0:0:0 - MKD	1.008.093.728	1.068.028.823	0	0	0	59.935.095	0
	MKMINF20G499 - DO2013/01-0118 9.1.2018 0:0:0 - MKD	184.748.846	195.095.751	0	0	0	10.346.905	0
	MKMINF20G507 - DO2013/03-0118 24.1.2018 0:0:0 - MKD	59.795.832	62.999.175	0	0	0	3.203.343	0
	MKMINF20GA71 - DO2014/25-1019 16.10.2019 0:0:0 - MKD	67.849.760	70.574.252	0	0	0	2.724.492	0
	MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	240.035.000	245.867.751	0	0	0	5.832.751	0
	MKMINF200D50 - RMDEN05 31.5.2016 0:0:0 - EUR	13.892.749	14.864.119	-131.308	11.007	76.461	1.015.210	0
	MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	47.366.369	50.226.333	-329.711	43.669	172.550	2.973.456	0

	MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	2.689.758	2.844.790	5.908	10.990	7.630	130.503	0
	MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	16.683.151	17.541.955	-369.629	89.093	38.563	1.100.778	0
	MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	119.261.656	125.017.109	-759.631	0	250.772	6.264.312	0
	MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	72.905	72.329	-1.547	0	121	850	0
	MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	129.162	130.081	-824	0	214	1.529	0
	MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	44.329.506	45.374.030	-1.206.333	0	101.969	2.148.889	0
	MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	90.983.446	94.722.263	-219.482	0	189.032	3.769.268	0
	MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	99.891.267	102.536.223	1.218.706	0	-117.796	1.544.045	0
	MKMINF20G226 - DO2011/02-0916-DK 29.9.2016 0:0:0 - EUR	143.746.488	152.276.333	0	0	291.585	8.238.260	0
	MKMINF20G259 - DO2012/01-0317-DK 26.3.2017 0:0:0 - EUR	197.294.784	208.698.650	0	0	398.006	11.005.860	0
	MKMINF20G267 - DO2012/02-0617-DK 25.6.2017 0:0:0 - EUR	67.950.813	71.934.140	0	0	137.591	3.845.736	0
	MKMINF20G325 - DO2012/07-0817-DK 16.8.2017 0:0:0 - EUR	506.600.214	536.434.882	0	0	932.906	28.901.761	0
	MKMINF20G341 - DO2012/09-0917-DK 6.9.2017 0:0:0 - EUR	106.763.487	113.077.445	0	0	209.015	6.104.943	0
	MKMINF20G358 - DO2012/10-0917-DK 20.9.2017 0:0:0 - EUR	143.937.906	152.481.131	0	0	291.237	8.251.988	0
	MKMINF20G382 - DO2012/13-1017-DK 4.10.2017 0:0:0 - EUR	114.899.947	121.732.766	0	0	232.875	6.599.945	0
	MKMINF20G390 - DO2012/14-1017-DK 18.10.2017 0:0:0 - EUR	114.661.391	121.492.547	0	0	230.679	6.600.477	0
	MKMINF20G408 - DO2012/15-1117-DK 1.11.2017 0:0:0 - EUR	114.417.845	121.246.887	0	0	228.358	6.600.684	0
	MKMINF20G424 - DO2012/17-1117-DK 23.11.2017 0:0:0 - EUR	401.018.228	425.023.448	0	0	772.491	23.232.730	0
	MKMINF20G481 - DO2013/02-0118-DK 9.1.2018 0:0:0 - EUR	430.239.826	454.323.385	0	0	790.506	23.293.053	0
	MKMINF20G523 - DO2013/05-0218-DK 28.2.2018 0:0:0 - EUR	59.370.815	62.563.855	0	0	109.955	3.083.085	0
	MKMINF20G549 - DO2013/07-0318-DK 7.3.2018 0:0:0 - EUR	79.009.829	83.274.677	0	0	155.549	4.109.299	0

	MKMINF20G556 - DO2013/08-0318-DK 14.3.2018 0:0:0 - EUR	88.760.370	93.559.858	0	0	178.200	4.621.288	0
	MKMINF20G572 - DO2013/10-0418-DK 4.4.2018 0:0:0 - EUR	78.695.986	82.961.817	0	0	156.154	4.109.676	0
	MKMINF20G580 - DO2013/11-0418-DK 25.4.2018 0:0:0 - EUR	58.909.297	61.954.500	0	0	110.891	2.934.312	0
	MKMINF20G606 - DO2013/13-0518-DK 30.5.2018 0:0:0 - EUR	175.857.237	185.012.860	0	0	352.158	8.803.466	0
	MKMINF20G671 - DO2013/20-0718DK 18.7.2018 0:0:0 - EUR	116.575.504	122.311.437	0	0	232.738	5.503.195	0
	MKMINF20G705 - DO2013/23-0718DK 25.7.2018 0:0:0 - EUR	58.279.747	61.148.963	0	0	114.452	2.754.763	0
	MKMINF20G721 - DO2013/25-0818DK 30.8.2018 0:0:0 - EUR	179.289.390	188.136.024	0	0	332.699	8.513.936	0
	MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	231.489.422	242.996.446	0	0	461.950	11.045.075	0
	MKMINF20G762 - DO2013/29-1018DK 17.10.2018 0:0:0 - EUR	57.777.445	60.652.860	0	0	114.580	2.760.835	0
	MKMINF20G770 - DO2013/30-1018DK 31.10.2018 0:0:0 - EUR	76.900.226	80.732.023	0	0	151.478	3.680.319	0
	MKMINF20G788 - DO2013/31-1118DK 21.11.2018 0:0:0 - EUR	134.206.024	140.902.782	0	0	256.613	6.440.145	0
	MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	86.099.462	90.406.050	0	0	167.768	4.138.819	0
	MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	95.185.637	99.958.737	0	0	185.367	4.587.733	0
	MKMINF20G838 - DO2014/01-0119DK 23.1.2019 0:0:0 - EUR	99.433.622	104.204.966	0	0	183.250	4.588.094	0
	MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	44.526.044	46.672.456	0	0	82.511	2.063.902	0
	MKMINF20G903 - DO2014/08-0319DK 27.3.2019 0:0:0 - EUR	29.569.761	31.003.521	0	0	58.193	1.375.566	0
	MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	147.198.609	154.358.758	0	0	278.930	6.881.219	0
	MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	88.346.929	92.648.614	0	0	165.620	4.136.065	0
	MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	293.066.025	307.420.714	0	0	584.882	13.769.807	0
	MKMINF20G960 - DO2014/14-0619DK 19.6.2019 0:0:0 - EUR	58.510.921	61.380.546	0	0	116.754	2.752.871	0
	MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	210.220.650	221.251.419	0	0	415.819	10.614.950	0

	MKMINF20GA06 - DO2014/18-0824DK 21.8.2024 0:0:0 - EUR	72.926.487	76.784.935	0	0	134.335	3.724.113	0
	MKMINF20GA14 - DO2014/19-0924DK 4.9.2024 0:0:0 - EUR	48.296.992	50.891.688	0	0	92.850	2.501.846	0
	MKMINF20GA30 - DO2014/21-1017DK 2.10.2017 0:0:0 - EUR	50.314.366	50.516.147	0	0	-21.280	223.062	0
	MKMINF20GA89 - DO2014/26-1019DK 16.10.2019 0:0:0 - EUR	28.900.549	30.091.441	0	0	56.764	1.134.128	0
	MKMINF20GC79 - DO2015/05-0230DK 12.2.2030 0:0:0 - EUR	130.035.000	134.803.125	0	0	187.465	4.580.660	0
	MKMINF20GD03 - DO2015/08-0230DK 26.2.2030 0:0:0 - EUR	50.012.500	51.772.975	0	0	76.221	1.684.254	0
	MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	260.035.001	268.041.775	0	0	-325.034	8.331.809	0
	MKMINF20GD52 - DO2015/13-0330DK 26.3.2030 0:0:0 - EUR	60.012.500	61.746.034	0	0	-95.371	1.828.905	0
	MKMINF20GD78 - DO2015/15-0430DK 16.4.2030 0:0:0 - EUR	170.035.000	174.768.149	0	0	-60.569	4.793.718	0
	MKMINF20GD94 - DO2015/17-0530DK 7.5.2030 0:0:0 - EUR	90.027.000	92.414.056	0	0	55.371	2.331.685	0
	MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	180.035.000	184.021.404	0	0	144.868	3.841.537	0
	MKMINF20GE36 - DO2015/21-0625DK 25.6.2025 0:0:0 - EUR	120.035.000	121.989.773	0	0	-196.408	2.151.181	0
	MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	190.035.000	192.874.173	0	0	-312.991	3.152.164	0
	MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	190.035.000	193.320.758	0	0	-313.217	3.598.974	0
	MKMINF20GE93 - DO2015/27-0725DK 23.7.2025 0:0:0 - EUR	140.035.000	141.945.062	0	0	-224.909	2.134.971	0
	MKMINF20GF27 - DO2015/30-0825DK 6.8.2025 0:0:0 - EUR	70.021.000	71.067.250	0	0	69.770	976.481	0
	MKMINF20GF76 - DO2015/35-0825DK 27.8.2025 0:0:0 - EUR	120.035.000	121.668.231	0	0	198.353	1.434.877	0
	MKMINF20GG34 - DO2015/41-1030DK 29.10.2030 0:0:0 - EUR	270.035.000	271.546.361	0	0	-319.915	1.831.275	0
	Обврзници издадени или гарантирани од Народна Банка на Република Македонија							
	Обврзници издадени или гарантирани од домашни банки							

	Обврзници издадени од домашни акционерски друштва, освен банки							
	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	82.577.607	83.028.921	529.240	0	-226.273	148.347	0
	US912810RN00 - US TREASURY 30 15.8.2045 0:0:0 - USD	82.577.607	83.028.921	529.240	0	-226.273	148.347	0
	Обврзници и други должнички хартии од вредност издадени од странски единици на локална самоуправа							
	Обврзници и други должнички хартии од вредност издадени од странски компании и банки							
	Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија	292.667.500	293.052.132	0	0	0	384.632	0
	MKMINFDYF230 - DZ2015/23-364 1.12.2016 0:0:0 - MKD	97.564.500	97.749.722	0	0	0	185.222	0
	MKMINFDYF248 - DZ2015/24-364 14.12.2016 0:0:0 - MKD	195.103.000	195.302.410	0	0	0	199.410	0
	Благајнички записи издадени од Народна Банка на Република Македонија							
	Сертификати за депозит и комерцијални записи издадени или гарантирани од домашни банки							
	Хартии од вредност врз основа на хипотека издадени од домашни банки							
	Комерцијални записи издадени од домашни акционерски друштва, освен банки							
	Удели во домашни отворени инвестициони фондови							

	Други ненаведени домашни хартии од вредност							
	Трезорски записи издадени од странски влади							
	Благајнички записи издадени странски централни банки							
	Комерцијални записи издадени од странски компании и банки							
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	2.496.784.172	2.583.415.401	0	86.631.229	0	0	0
	DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	220.866.508	240.613.598	0	19.747.091	0	0	0
	US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	56.986.461	55.176.624	0	-1.809.837	0	0	0
	US4642862100 - ISHARES INTERNATIONAL HIGH YIELD BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	69.796.199	66.035.168	0	-3.761.031	0	0	0
	US4642865251 - ISHARES MSCI ALL COUNTRY WORLD MINIMUM VOLATILITY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	240.020.369	244.456.423	0	4.436.054	0	0	0
	US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	68.210.192	71.952.168	0	3.741.976	0	0	0
	US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	128.419.386	130.874.952	0	2.455.566	0	0	0
	US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	92.607.770	83.860.720	0	-8.747.050	0	0	0
	US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	161.036.998	171.562.971	0	10.525.974	0	0	0

US4642868487 - ISHARES MSCI JAPAN ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	215.706.440	244.537.941	0	28.831.501	0	0	0
US4642868552 - ISHARES INC-MSCI ITALY CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	95.793.052	104.264.463	0	8.471.411	0	0	0
US4642872422 - ISHARES IBOX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	55.027.686	57.845.208	0	2.817.522	0	0	0
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	162.096.004	186.265.030	0	24.169.026	0	0	0
US4642874659 - ISHARES MSCI EAFE ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	66.975.811	72.112.089	0	5.136.278	0	0	0
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	190.147.346	159.578.789	0	-30.568.558	0	0	0
US4642986065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	48.294.685	45.853.528	0	-2.441.158	0	0	0
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	310.412.462	319.512.781	0	9.100.319	0	0	0
US78464A1512 - SPDR BARCLAYS INTERNATIONAL CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	54.614.203	53.131.745	0	-1.482.459	0	0	0
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	259.772.600	275.781.203	0	16.008.603	0	0	0
Други ненаведени хартии од вредност издадени од странски влади и компании							
ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	15.713.983.525	16.437.279.873	-1.264.612	242.204.948	9.121.308	473.234.704	0

Забелешка: Вкупната разлика помеѓу објективната (фер) вредност и трошокот на набавка е еднаква вкупно нереализираните 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.

1. 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	32.845.491	0	0	0	0	0	32.845.491
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	5.581.686.085	3.849.295	5.585.535.380
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	9.020.773.961	9.020.773.961
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	545.399.273	466.170.427	556.644.405	0	0	2.041.165.949	3.609.380.054
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	376.691.098	0	376.691.098
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	578.244.764	466.170.427	556.644.405	0	5.958.377.183	11.065.789.206	18.625.225.985
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	47.222.889	0	47.222.889
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	47.222.889	0	47.222.889
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	578.244.764	466.170.427	556.644.405	0	5.911.154.293	11.065.789.206	18.578.003.095

2. 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	3,48	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти расположливи за продавање	5,60	5,00	3,04	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	4,77	4,02	0,00	0,00	0,00
Обврски	%	%	%	%	%
Обврски по основ на заеми и кредити					

3. 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	32.845.491	0	0	0	32.845.491
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	5.585.535.380	0	0	0	5.585.535.380
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	9.020.773.961	0	0	0	9.020.773.961
4) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	746.194.416	517.452.602	1.126.418.752	1.219.314.284	3.609.380.054
5) Останати средства на пензискиот фонд	376.691.098	0	0	0	376.691.098
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	15.762.040.347	517.452.602	1.126.418.752	1.219.314.284	18.625.225.984
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	47.222.889	0	0	0	47.222.889
8) Вкупно обврски (6+7)	47.222.889	0	0	0	47.222.889
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	15.714.817.458	517.452.602	1.126.418.752	1.219.314.284	18.578.003.095
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	15.714.817.458	16.232.270.060	17.358.688.812	18.578.003.096	

4. 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	392.012	0	31.893.119	560.361	0	32.845.492
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	829.916.223	1.081.691.538	3.545.445.229	0	128.482.389	5.585.535.380
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	2.292.179.503	6.645.565.537	83.028.921	0	0	9.020.773.961
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	1.924.151.989	1.685.228.066	0	0	0	3.609.380.055
5) Останати средства на пензискиот фонд	375.990.250	0	700.848	- 0	0	376.691.098
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	5.422.629.976	9.412.485.142	3.661.068.117	560.361	128.482.390	18.625.225.986
Обврски	19.632.896	-55.312.798	82.902.792	0	0	47.222.889

5. 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)						