



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен доброволен пензиски фонд

НЛБ Пензија плус

За период од 01.01. до 31.12. 2016 година



NLB

Нов пензиски фонд

Содржина

1.	Извештај за нето средства на НЛБ Пензија плус	3
2.	Извештај за работењето на НЛБ Пензија плус	4
3.	Извештај за промени на нето средства на НЛБ Пензија плус	5
4.	Финансиски показатели според сметководствените единици	6
5.	Извештај за бројот на сметководствени единици	7
6.	Извештај за структура на инвестициите	8
7.	Структура на инвестициите на НЛБ Пензија плус	14
8.	Извештај за реализирани добивки и загуби	14
9.	Извештај за нереализирани добивки и загуби	16

1. Извештај за нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија плус на ден 31.12.2016

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	31.12.2015 (во 000 ден.)	31.12.2016 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
1	10	Парични средства	3	1.823	4.685
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		6	188
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ		0	0
5	14	Побарувања од други пензиски фондови		0	0
6	15	Побарувања за дадени аванси		0	0
7	16	Побарувања од пензиските друштва или чуварот на имот		0	0
8	17	Побарувања од државата и други институции		0	0
9	18	Побарувања за хартии од вредност купени директно од издавачот		0	0
10	19	Платени трошоци за идните периоди и недостасана наплата на приходи (АВР)		0	0
11		Вложувања во хартии од вредност и депозити (12+13+14)	4	336.710	456.178
12	3	Финансиски средства кои се чуваат за тргување		139.790	183.314
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		144.944	174.283
14	5	Финансиски средства кои се чуваат до достасување		51.976	98.581
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		338.539	461.051
16	20	Обврски за неконвертирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		0	1.228
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		19	0
19	23	Обврски за пренос на средства на други пензиски фондови по основ на промена на членство		0	137
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	366	553
23	27	Обврски за брокерски и посреднички провизии		0	0
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		1	58
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		386	1.976
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		338.153	459.075
28		Број на издадени сметководствени единици		2.292.008,401293	2.969.860,269841
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		147,535595	154,578082
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		304.263	412.053
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		1	1.052
32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-13.801	-21.477
33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-409	-549
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		12.132	21.390
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		35.216	47.348
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	6	750	-742
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		338.153	459.075

2. Извештај за работењето на ОДФФ НЛБ Пензија плус 01.01.- 31.12.2016 година

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Бележки	31.12.2015 (во 000 ден.)	31.12.2016 (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	6.863	8.470
2	71	Приходи од дивиденди	8	3.179	3.842
3	73	Реализирани капитални добивки	9	2.287	887
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		1.851	1.276
5	75	Други неспоменати приходи		0	0
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		14.180	14.475
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	10	3.386	4.545
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	11	789	256
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		1.748	1.046
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	12	89	51
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		1	1
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		6.013	5.899
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		8.167	8.576
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	13	3.836	13.045
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		129	-231
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		3.965	12.814
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		12.132	21.390

3. Извештај за промени на нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија плус во периодот 01.01.2016 до 31.12.2016 година

Ознака на позиција	Група на сметки	ПОЗИЦИЈА	31.12.2015 (во 000 ден.)	31.12.2016 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5
		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТВЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
1	Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	8.167	8.576
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	3.965	12.814
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	41	-1.492
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	12.173	19.898
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	87.542	107.790
6	91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	1	1.051
7	92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-4.744	-7.676
8	93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-284	-140
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	82.515	101.025
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	94.688	120.923
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	243.465	338.153
12		На крајот на периодот (10+11)	338.153	459.075
		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	599.329,569631	723.644,660900
14		Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	8,437218	31,569129
15		Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-32.733,534987	-52.099,579732
16		Повлечени сметководствени единици врз основа на пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-1.951,533978	6.275,218251
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	564.652,937884	677.851,868548

4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01-31.12.2016

Ознака на позиција	ПОЗИЦИЈА	31.12.2015 (во 000 ден.)	31.12.2016 (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	243.465	338.153
2	Број на сметководствени единици на почетокот на периодот	1.727.355,463409	2.292.008,401293
3	Вредност на сметководствената единица на почетокот на периодот (1/2)	140,946772	147,535595
	Вредноста на нето средствата на пензискиот фонд по сметководствена единица на крајот на периодот		
4	Нето средства на пензискиот фонд на крајот на периодот	338.153	459.075
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	2.292.008,401293	2.969.860,269841
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	147,535595	154,578082
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,012103	0,011925
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,028444	0,022252
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	6,16%	5,96%

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

287.121

385.410

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

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

Реалната стапка на принос за периодот 31.12.2009 - 31.12.2016 сведена на годишно ниво изнесува 4,36%, додека за периодот 31.12.2009-31.12.2015 изнесува 4,25%.

**5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОДФ НЛБ
Пензија плус за периодот 01.01-31.12.2016**

реден број	ПОЗИЦИЈА	Број на сметководствени единици	Извори на средствата на фондот
1	2	3	4
1	На почетокот на периодот	2.292.008,401293	290.054
2	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	723.644,660900	107.790
3	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство во текот на периодот	31,569129	1.051
4	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-52.099,579732	-7.676
5	Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	6.275,218251	-140
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	2.969.860,269841	391.079
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		147,535595
	На крајот на периодот		154,578082

6. Извештај за структура на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија плус за периодот 01.01-31.12.2016

(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							
MKALKA101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.532	5.440	8.334.589	5.387	8.253.098	0,11%	1,79%
MKFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	16	37.830	605.280	42.000	672.000	0,09%	0,15%
MKGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.443	490	7.077.070	580	8.376.940	0,47%	1,82%
MKMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	21.614	280	6.062.339	260	5.619.640	0,02%	1,22%
MKMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.611	3.823	9.982.980	3.699	9.657.436	0,58%	2,09%
MKONBA101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.200	2.930	3.516.250	3.812	4.574.400	0,27%	0,99%
MKRRV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	268	28.103	7.531.589	34.500	9.246.000	0,67%	2,01%
MKREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	160	41.019	6.563.000	43.000	6.880.000	0,62%	1,49%
MKVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	501	8.941	4.479.539	8.755	4.386.255	0,65%	0,95%
MKVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.346	2.600	3.499.600	2.300	3.095.800	0,50%	0,67%
Приоритетни акции							
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			57.652.236		60.761.570		13,18%

Обични акции								
BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	328	6.935	2.274.596	6.182	2.027.675	0,00%	0,44%	
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	644	4.621	2.976.194	4.242	2.732.012	0,00%	0,59%	
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	517	4.145	2.143.022	4.182	2.162.167	0,00%	0,47%	
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	611	5.391	3.293.600	5.456	3.333.895	0,00%	0,72%	
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	362	5.403	1.955.754	7.181	2.599.524	0,00%	0,56%	
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	248	9.755	2.419.283	9.653	2.393.832	0,00%	0,52%	
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	485	4.185	2.029.774	5.429	2.633.261	0,00%	0,57%	
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	429	4.752	2.038.433	4.728	2.028.271	0,00%	0,44%	
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.551	1.490	2.310.959	1.475	2.287.146	0,00%	0,50%	
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	270	8.821	2.381.646	11.153	3.011.226	0,00%	0,65%	
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	650	3.083	2.003.938	3.723	2.419.746	0,00%	0,52%	
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	34	43.860	1.491.235	46.220	1.571.490	0,00%	0,34%	
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	10	45.009	450.085	43.737	437.368	0,00%	0,09%	
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	230	8.919	2.051.283	8.528	1.961.398	0,00%	0,43%	
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	433	5.771	2.498.743	6.755	2.925.042	0,00%	0,63%	
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	141	15.839	2.233.254	16.540	2.332.144	0,00%	0,51%	
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	690	2.431	1.677.100	2.418	1.668.549	0,00%	0,36%	
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	390	1.756	684.864	1.843	718.807	0,00%	0,16%	
US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	300	1.919	575.695	3.155	946.453	0,00%	0,21%	
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	196	7.427	1.455.642	7.820	1.532.783	0,00%	0,33%	
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	482	3.616	1.742.916	5.033	2.425.874	0,00%	0,53%	
US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	455	4.720	2.147.587	4.461	2.029.910	0,00%	0,44%	
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	690	2.968	2.048.110	3.624	2.500.812	0,00%	0,54%	
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	335	4.863	1.628.964	6.822	2.285.298	0,00%	0,50%	
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	661	3.315	2.190.904	3.238	2.140.482	0,00%	0,46%	
US9182041080 - VF CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	220	3.509	772.047	3.112	684.570	0,00%	0,15%	
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	820	2.673	2.191.720	3.113	2.553.014	0,00%	0,55%	
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	648	3.007	1.948.827	3.214	2.082.889	0,00%	0,45%	
Приоритетни акции	21	42.781	898.409	45.017	945.357	0,00%	0,21%	
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	21	42.781	898.409	45.017	945.357	0,00%	0,21%	
Акции во затворени инвестициони фондови								
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			54.514.586		59.370.995		12,88%	
Вкупно вложувања во акции			112.166.821		120.132.565		26,06%	

(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					
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	10.000.000	9.980.572	10.245.055	8,33%	2,22%
MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	76.811	4.535.124	4.732.503	4,27%	1,03%
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	21.507	1.276.663	1.311.311	0,36%	0,28%
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	46.928	2.781.934	2.848.349	0,68%	0,62%
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	319.761	18.827.653	19.213.557	2,66%	4,17%
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	47.770	2.733.646	2.850.981	0,87%	0,62%
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	70.532	4.076.992	4.170.447	1,18%	0,90%
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	43.308	2.442.010	2.547.433	0,48%	0,55%
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	244.202	14.075.987	14.289.026	3,05%	3,10%
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	414.453	23.899.829	24.123.608	4,85%	5,23%
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	218.929	12.577.025	12.675.096	1,82%	2,75%
MKMINF20G259 - DO2012/01-0317 26.3.2017 0:0:0 - EUR	32.521	1.976.762	2.083.339	0,79%	0,45%
MKMINF20G267 - DO2012/02-0617 25.6.2017 0:0:0 - EUR	48.686	2.917.987	3.077.620	0,26%	0,67%
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	97.549	5.756.960	6.075.891	4,76%	1,32%
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	16.260	955.368	1.008.609	0,32%	0,22%
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	48.785	2.856.887	3.016.426	0,59%	0,65%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	65.033	3.866.339	4.043.000	0,92%	0,88%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	48.763	2.875.667	3.008.155	2,02%	0,65%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	19.460	1.144.478	1.197.354	0,39%	0,26%
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	64.846	3.964.691	4.141.237	1,40%	0,90%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	97.274	5.898.563	6.163.516	2,73%	1,34%
MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	102.137	6.752.022	6.995.289	6,67%	1,52%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	64.975	3.933.398	4.110.384	2,50%	0,89%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	81.066	4.894.268	5.115.108	1,18%	1,11%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	97.498	5.836.597	6.125.565	2,33%	1,33%

MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	64.861	3.964.291	4.117.024	0,49%	0,89%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	81.242	4.936.776	5.103.001	0,00%	1,11%
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	64.834	3.921.101	4.053.640	2,06%	0,88%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	64.834	3.910.531	4.063.129	0,64%	0,88%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	24.313	1.500.405	1.545.851	1,20%	0,34%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	24.314	1.500.405	1.543.382	1,00%	0,33%
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	162.092	10.002.700	10.206.562	12,50%	2,21%
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	48.787	3.000.810	3.047.306	1,95%	0,66%
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	56.906	3.500.945	3.540.133	1,56%	0,77%
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	65.047	4.001.080	4.043.361	1,10%	0,88%
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	58.227	3.580.967	3.593.261	0,77%	0,78%
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	129.460	7.962.149	7.969.775	0,91%	1,73%
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		202.619.583	207.995.282		45,11%
Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки					
FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26 CORP 25.5.2026 0:0:0 - EUR	40.000	2.467.037	2.442.510	0,00%	0,53%
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 GOVT 15.5.2026 0:0:0 - USD	72.000	4.013.120	3.921.385	0,00%	0,85%
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		6.480.157	6.363.895		1,38%
Вкупно инвестиции во обврзници		209.099.740	214.359.177		46,49%

(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	0,00%	0,00%
Удели во отворени инвестициони фондови					
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.069	6.063.585	6.597.315	0,00%	1,43%
US33733E2037 - FIRST TRUST NY SE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	325	1.806.300	1.722.711	0,00%	0,37%
US4642865251 - EDGE ISHARES MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.730	6.755.745	7.326.613	0,01%	1,59%
US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	440	583.216	633.115	0,00%	0,14%
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.500	3.903.434	4.189.251	0,02%	0,91%
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	600	956.223	927.730	0,00%	0,20%
US4642868065 - ISHARES INC. - MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.010	2.927.944	3.104.379	0,00%	0,67%

US4642872422 - ISHARES TR IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	200	1.285.449	1.366.923	0,00%	0,30%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	557	2.998.286	3.569.723	0,01%	0,77%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.180	2.252.428	2.858.967	0,00%	0,62%
US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.110	1.131.054	1.173.067	0,01%	0,25%
US46434G8226 - BLACK ROCK INC. USA - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.222	8.726.177	9.182.051	0,00%	1,99%
US46434G8309 - BLACK ROCK INC. USA - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	535	790.957	755.456	0,00%	0,16%
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.366	5.844.492	6.182.263	0,02%	1,34%
US9229083632 - THE VANGUARD GROUP - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.135	12.076.800	13.591.477	0,00%	2,95%
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		58.102.089	63.181.042		13,70%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		58.102.089	63.181.042		13,70%

(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	7.694.536	7.707.504	1,67%
Долгорочни депозити	50.400.000	50.797.421	11,02%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	58.094.536	58.504.925	12,69%

7. Структура на инвестициите на ОДФФ НЛБ Пензија плус во видови на финансиски средства на ден 31.12.2016

ОПИС	Вкупна вредност на денот на известувањето (во денари)	Процентуален удел во вредноста на пензискиот фонд
Акции	120.132.565	26,06%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	214.359.177	46,49%
Краткорочни хартии од вредност	0	0,00%
Акции и удели во инвестициони фондови	63.181.042	13,70%
Парични средства	4.685.624	1,02%
Пласмани и депозити	58.504.925	12,69%
Останати средства	187.965	0,04%
Вкупно средства	461.051.298	100,00%

8. Извештај за реализирани добивки и загуби на ОДФФ НЛБ Пензија плус за период 01.01.- 31.12.2016

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 од странски компании и банки	641	2.789.568	3.455.144	665.576
05.12.2016	FR0000131104 - BNP	100	308.298	339.001	30.703
08.06.2016	US4370761029 - HD	60	445.605	421.872	-23.733
05.12.2016	US46625H1005 - JPM	150	542.401	717.172	174.770
05.12.2016	US6934751057 - PNC	75	364.693	486.145	121.451
21.11.2016	US9078181081 - UNP	256	1.128.570	1.490.955	362.384

	Удели во странски отворени инвестициони фондови	6.713	9.776.839	9.742.042	-34.797
16.03.2016	US4642862100 - HYXU	100	250.133	255.461	5.328
17.03.2016	US4642862100 - HYXU	100	250.133	262.078	11.944
28.03.2016	US4642862100 - HYXU	100	250.133	258.039	7.905
31.03.2016	US4642862100 - HYXU	90	225.120	232.857	7.737
02.06.2016	US4642867075 - EWQ	230	313.910	312.772	-1.137
07.06.2016	US4642867075 - EWQ	230	313.910	314.821	912
02.06.2016	US4642867562 - EWD	195	308.915	316.532	7.617
07.06.2016	US4642867562 - EWD	195	308.915	320.763	11.847
02.06.2016	US4642868065 - EWG	550	812.045	786.499	-25.546
07.06.2016	US4642868065 - EWG	550	812.045	793.494	-18.551
02.06.2016	US4642868552 - EWI	475	351.126	314.710	-36.415
07.06.2016	US4642868552 - EWI	475	351.126	318.890	-32.236
08.08.2016	US4642868552 - EWI	410	303.077	248.715	-54.362
10.08.2016	US4642868552 - EWI	410	303.077	254.907	-48.170
08.08.2016	US4642877967 - IYE	300	572.651	632.535	59.884
10.08.2016	US4642877967 - IYE	300	572.651	631.160	58.509
02.06.2016	US78463X8487 - CWI	725	1.258.840	1.242.718	-16.122
07.06.2016	US78463X8487 - CWI	725	1.258.840	1.259.184	343
16.03.2016	US78464A1512 - IBND	140	243.086	246.387	3.300
17.03.2016	US78464A1512 - IBND	130	225.723	234.866	9.143
28.03.2016	US78464A1512 - IBND	140	243.086	249.165	6.078
31.03.2016	US78464A1512 - IBND	143	248.295	255.490	7.195
	ВКУПНО РЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ				630.779

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

9. Извештај за нереализирани добивки и загуби на ОДФФ НЛБ Пензија плус за период 1.1.- 31.12.2016

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	57.652.236	60.761.570	0	3.109.334	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.334.589	8.253.098	0	-81.491	0	0	0
	МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	605.280	672.000	0	66.720	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.077.070	8.376.940	0	1.299.870	0	0	0
	МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.062.339	5.619.640	0	-442.699	0	0	0
	МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.982.980	9.657.436	0	-325.544	0	0	0
	МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.516.250	4.574.400	0	1.058.150	0	0	0
	МКРРIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.531.589	9.246.000	0	1.714.411	0	0	0
	МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.563.000	6.880.000	0	317.000	0	0	0
	МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	4.479.539	4.386.255	0	-93.284	0	0	0
	МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.499.600	3.095.800	0	-403.800	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	53.616.176	58.425.638	0	4.809.462	0	0	0
	BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.274.596	2.027.675	0	-246.922	0	0	0
	CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.976.194	2.732.012	0	-244.182	0	0	0
	CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.143.022	2.162.167	0	19.146	0	0	0
	DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.293.600	3.333.895	0	40.295	0	0	0
	DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.955.754	2.599.524	0	643.770	0	0	0
	DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.419.283	2.393.832	0	-25.451	0	0	0
	DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.029.774	2.633.261	0	603.487	0	0	0
	FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.038.433	2.028.271	0	-10.162	0	0	0
	FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.310.959	2.287.146	0	-23.814	0	0	0
	FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.381.646	3.011.226	0	629.580	0	0	0

	FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.003.938	2.419.746	0	415.808	0	0	0
	US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.491.235	1.571.490	0	80.255	0	0	0
	US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	450.085	437.368	0	-12.718	0	0	0
	US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.051.283	1.961.398	0	-89.885	0	0	0
	US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.498.743	2.925.042	0	426.299	0	0	0
	US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.233.254	2.332.144	0	98.891	0	0	0
	US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.677.100	1.668.549	0	-8.550	0	0	0
	US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	684.864	718.807	0	33.943	0	0	0
	US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	575.695	946.453	0	370.757	0	0	0
	US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.455.642	1.532.783	0	77.141	0	0	0
	US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.742.916	2.425.874	0	682.958	0	0	0
	US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.147.587	2.029.910	0	-117.677	0	0	0
	US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.048.110	2.500.812	0	452.702	0	0	0
	US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.628.964	2.285.298	0	656.334	0	0	0
	US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.190.904	2.140.482	0	-50.422	0	0	0
	US9182041080 - VF CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	772.047	684.570	0	-87.477	0	0	0
	US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.191.720	2.553.014	0	361.294	0	0	0
	US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.948.827	2.082.889	0	134.062	0	0	0
	Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	898.409	945.357	0	46.948	0	0	0
	US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	898.409	945.357	0	46.948	0	0	0
	Акции во затворени инвестициони фондови издадени од странски компании и банки							
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	202.619.583	207.995.284	-1.177.676	0	-320.894	6.874.269	0
	MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	9.980.572	10.245.055	0	0	0	264.483	0
	MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	4.535.124	4.732.503	-46.406	0	-474	244.258	0
	MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	1.276.663	1.311.311	-12.810	0	-2.060	49.519	0
	MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	2.781.934	2.848.349	-31.117	0	-3.063	100.595	0
	MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	18.827.653	19.213.557	-364.696	0	-26.757	777.358	0
	MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	2.733.646	2.850.981	8.025	0	-4.296	113.605	0
	MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	4.076.992	4.170.447	-36.552	0	-7.074	137.081	0
	MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	2.442.010	2.547.433	9.660	0	-3.852	99.615	0
	MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	14.075.987	14.289.026	-211.261	0	-23.060	447.360	0
	MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	23.899.829	24.123.608	-454.852	0	-37.935	716.566	0
	MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	12.577.025	12.675.096	-37.666	0	-29.281	165.018	0
	MKMINF20G259 - DO2012/01-0317 26.3.2017 0:0:0 - EUR	1.976.762	2.083.339	0	0	-3.671	110.248	0
	MKMINF20G267 - DO2012/02-0617 25.6.2017 0:0:0 - EUR	2.917.987	3.077.620	0	0	-5.417	165.050	0
	MKMINF20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	5.756.960	6.075.891	0	0	-11.758	330.689	0
	MKMINF20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	955.368	1.008.609	0	0	-1.880	55.120	0
	MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	2.856.887	3.016.426	0	0	-5.837	165.377	0
	MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	3.866.339	4.043.000	0	0	-7.766	184.427	0

MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	2.875.667	3.008.155	0	0	-5.797	138.285	0
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.144.478	1.197.354	0	0	-2.308	55.185	0
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	3.964.691	4.141.237	0	0	-7.345	183.891	0
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	5.898.563	6.163.516	0	0	-10.928	275.881	0
MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	6.752.022	6.995.289	0	0	-12.401	255.667	0
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	3.933.398	4.110.384	0	0	-7.290	184.277	0
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	4.894.268	5.115.108	0	0	-9.074	229.914	0
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	5.836.597	6.125.565	0	0	-11.748	300.716	0
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	3.964.291	4.117.024	0	0	-7.340	160.074	0
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	4.936.776	5.103.001	0	0	-9.135	175.360	0
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	3.921.101	4.053.640	0	0	-7.404	139.944	0
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	3.910.531	4.063.129	0	0	-7.411	160.008	0
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.500.405	1.545.851	0	0	-5.256	50.702	0
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	1.500.405	1.543.382	0	0	-5.226	48.203	0
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	10.002.700	10.206.562	0	0	-34.566	238.427	0
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	3.000.810	3.047.306	0	0	-547	47.043	0
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	3.500.945	3.540.133	0	0	-1.375	40.563	0
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	4.001.080	4.043.361	0	0	-823	43.104	0
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	3.580.967	3.593.261	0	0	-105	12.399	0
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	7.962.149	7.969.775	0	0	-635	8.260	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	6.480.157	6.363.895	-312.046	0	177.430	18.354	0
FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26 CORP 25.5.2026 0:0:0 - EUR	2.467.037	2.442.510	-23.679	0	-8.557	7.709	0
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 GOVT 15.5.2026 0:0:0 - USD	4.013.120	3.921.385	-288.368	0	185.987	10.646	0
Обврзници и други должнички хартии од вредност издадени од странски единици на локална самоуправа							
Обврзници и други должнички хартии од вредност издадени од странски компании и банки							
Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија							
Благајнички записи издадени од Народна Банка на Република Македонија							
Сертификати за депозит и комерцијални записи издадени или гарантирани од домашни банки							

	Хартии од вредност врз основа на хипотека издадени од домашни банки								
	Комерцијални записи издадени од домашни акционерски друштва, освен банки								
	Удели во домашни отворени инвестициони фондови								
	Други ненаведени домашни хартии од вредност								
	Трезорски записи издадени од странски влади								
	Благајнички записи издадени странски централни банки								
	Комерцијални записи издадени од странски компании и банки								
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	58.102.089	63.181.042	0	5.078.954	0	0	0	0
	DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	6.063.585	6.597.315	0	533.730	0	0	0	0
	US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.806.300	1.722.711	0	-83.589	0	0	0	0
	US4642865251 - EDGE ISHARES MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	6.755.745	7.326.613	0	570.868	0	0	0	0
	US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	583.216	633.115	0	49.899	0	0	0	0
	US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.903.434	4.189.251	0	285.817	0	0	0	0
	US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	956.223	927.730	0	-28.492	0	0	0	0
	US4642868065 - ISHARES INC.- MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.927.944	3.104.379	0	176.435	0	0	0	0
	US4642872422 - ISHARES TR IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.285.449	1.366.923	0	81.474	0	0	0	0
	US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.998.286	3.569.723	0	571.438	0	0	0	0
	US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.252.428	2.858.967	0	606.540	0	0	0	0
	US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.131.054	1.173.067	0	42.013	0	0	0	0
	US46434G8226 - BLACK ROCK INC. USA - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	8.726.177	9.182.051	0	455.874	0	0	0	0
	US46434G8309 - BLACK ROCK INC. USA - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	790.957	755.456	0	-35.500	0	0	0	0
	US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	5.844.492	6.182.263	0	337.771	0	0	0	0
	US9229083632 - THE VANGUARD GROUP - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	12.076.800	13.591.477	0	1.514.677	0	0	0	0
	Други ненаведени хартии од вредност издадени од странски влади и компании								
	ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	379.368.650	397.672.785	-1.489.722	13.044.697	-143.465	6.892.624	0	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.

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	4.685.624	0	0	0	0	0	4.685.624
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	183.313.607	0	183.313.607
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	174.282.655	174.282.655
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување		1.910.154	38.240.003	0	0	58.431.290	98.581.448
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	187.965	0	187.965
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	4.685.624	1.910.154	38.240.003	0	183.501.572	232.713.945	461.051.298
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	1.975.992	0	1.975.992
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	1.975.992	0	1.975.992
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	4.685.624	1.910.154	38.240.003	0	181.525.579	232.713.945	459.075.306

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	4,08	2,46	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	3,35	4,22	0,01	0,00	0,00
Обврски	%	%	%	%	%
Обврски по основ на заеми и кредити					

Обелоденувања поврзани со ликвидносниот ризик

	Резидуална рочност на достасување на средствата и обврските				
	од 1 до 3 месеци	од 3 до 12 мес.	од 1 до 5 год.	над 5 год.	Вкупно
Средства					
1) Пари и депозити кај банки	4.685.624	0	0	0	4.685.624
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	183.313.607	0	0	0	183.313.607
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	174.282.655	0	0	0	174.282.655
4) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	5.770.244	2.680.779	50.740.003	39.390.421	98.581.448
5) Останати средства на пензискиот фонд	187.965	0	0	0	187.965
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	368.240.095	2.680.779	50.740.003	39.390.421	461.051.298
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	1.975.992	0	0	0	1.975.992
8) Вкупно обврски (6+7)	1.975.992	0	0	0	1.975.992
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	366.264.102	2.680.779	50.740.003	39.390.421	459.075.306
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	366.264.102	368.944.881	419.684.884	459.075.306	

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	4.685.624	0	0	0	0	4.685.624
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	60.761.570	29.331.891	88.325.967	0	4.894.179	183.313.607
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	10.245.055	160.116.215	3.921.385	0	0	174.282.655
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	56.594.771	40.242.752	1.743.925	0	0	98.581.448
5) Останати средства на пензискиот фонд	10.830	0	177.135	-	0	187.965
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	132.297.849	229.690.858	94.168.412	0	4.894.179	461.051.298
Обврски	694.454	0	1.281.538	0	0	1.975.992

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