



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен доброволен пензиски фонд

НЛБ Пензија плус

За првите девет месеци од 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 средствта 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	15
9.	Извештај за нереализирани добивки и загуби	18

1. Извештај за нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија плус на ден 30.09.2016

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	30.09.2015 (во 000 ден.)	30.09.2016 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
1	10	Парични средства	3	2.951	1.419
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		40	36
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	289.908	402.520
12	3	Финансиски средства кои се чуват за тргување		120.837	163.338
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		133.879	159.769
14	5	Финансиски средства кои се чуват до достасување		35.192	79.413
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		292.898	403.975
16	20	Обврски за неконвртирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		0	0
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		15	2.319
19	23	Обврски за пренос на средства на други пензиски фондови по основ на промена на членство		0	0
20	24	Краткорочни обврски за заеми и кредити		0	0
21	25	Долгорочни обврски за заеми и кредити		0	0
22	26	Обврски кон пензиското друштво	5	343	418
23	27	Обврски за брокерски и посреднички провизии		0	0
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		10	31
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		369	2.768
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		292.530	401.207
28		Број на издадени сметководствени единици		2.046.461,458809	2.685.627,555235
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		142,944063	149,390234
30	90	Парични прилив и по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		266.379	367.630
31	91	Парични прилив и по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		1	1.039
32	92	Парични одлив и по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-12.057	-20.639

33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови и од промена на членство		-356	-409
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		2.745	6.800
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		35.216	47.348
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	6	601	-562
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		292.530	401.207

2. Извештај за работењето на ОДПФ НЛБ Пензија плус на 30.09.2016 година

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	30.09.2015 (во 000 ден.)	30.09.2016 (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	5.047	6.121
2	71	Приходи од дивиденди	8	2.644	3.364
3	73	Реализирани капитални добивки	9	2.250	198
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		1.664	1.039
5	75	Други неспоменати приходи		0	0
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		11.605	10.722
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	10	2.456	3.277
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	11	773	256
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		1.577	899
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	12	74	39
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		1	1
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		4.881	4.472
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		6.724	6.250
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	13	-4.338	940
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		358	-390
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		-3.979	550
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		2.745	6.800

3. Извештај за промени на нето средствата на ОДФФ НЛБ Пензија плус во периодот 01.01.2016 до 30.09.2016 година

Ознака на позиција	Група на сметки	ПОЗИЦИЈА	30.09.2015 (во 000 ден.)	30.09.2016 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5
		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЌЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
1	Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	6.724	6.250
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	-3.979	550
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	-108	-1.313
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	2.637	5.487
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	49.659	63.367
6	91	Парични приливи и на средства од други пензиски фондови и од промена на членство	1	1.038
7	92	Парични одливи и по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-3.000	-6.838
8	93	Парични одливи и на средства во други пензиски фондови и од промена на членство	-231	0
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	46.429	57.567
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	49.066	63.054
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	243.465	338.153
12		На крајот на периодот (10+11)	292.530	401.207
		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици в рз основа на уплатени придонеси	341.433,637691	433.033,591110
14		Издадени сметководствени единици в рз основа на пренос на средства од други пензиски фондови и од промена на членство	8,437218	7.119,988498
15		Повлечени сметководствени единици в рз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-20.744,649537	-46.534,425666
16		Повлечени сметководствени единици в рз основа на пренос на средства во други пензиски фондови и од промена на членство	-1.591,429972	0,000000
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	319.105,995400	393.619,153942

4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01-30.09.2016

Ознака на позиција	ПОЗИЦИЈА	30.09.2015 (во 000 ден.)	30.09.2016 (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	292.530	401.207
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	2.046.461,458809	2.685.627,555235
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	142,944063	149,390234
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,009168	0,008987
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,024367	0,016939
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	5,85%	5,69%

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

275.948

368.976

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

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

Реалната стапка на принос за периодот 30.09.2009 - 30.09.2016 сведена на годишно ниво изнесува 3,94%, додека за периодот 31.12.2009-30.09.2015 изнесува 3,88%.

**5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОДФ НЛБ
Пензија плус за периодот 01.01-30.09.2016**

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 в рз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	433.033,591110	63.367
3	Издадени сметководствени единици в рз основа на пренос на средства од други пензиски фондови и од промена на членство во текот на периодот	7.119,988498	1.038
4	Повлечени сметководствени единици в рз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-46.534,425666	-6.838
5	Повлечени сметководствени единици в рз основа на пренос на средства во други пензиски фондови и од промена на членство	0,000000	0
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	2.685.627,555235	347.621
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		147,535595
	На крајот на периодот		149,390234

6. Извештај за структура на инвестициите на ОДФФ НЛБ Пензија плус за периодот 01.01-30.09.2016

(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							
МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИДАД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.382	5.445	7.524.589	5.445	7.525.045	0,10%	1,86%
МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	16	37.830	605.280	41.116	657.856	0,09%	0,16%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.443	490	7.077.070	527	7.605.106	0,47%	1,88%
МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	20.234	282	5.705.099	270	5.463.180	0,02%	1,35%
МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.481	3.828	9.497.590	3.491	8.661.171	0,55%	2,14%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.000	2.826	2.826.250	3.280	3.280.000	0,23%	0,81%
МКРРIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	268	28.103	7.531.589	30.500	8.174.059	0,67%	2,02%
МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	160	41.019	6.563.000	42.000	6.720.000	0,62%	1,66%
МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	437	8.971	3.920.259	8.343	3.645.891	0,57%	0,90%
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.346	2.600	3.499.600	2.500	3.365.000	0,50%	0,83%
Приоритетни акции							
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			54.750.326		55.097.308		13,64%
Обични акции							
BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	293	7.046	2.064.605	7.170	2.100.869	0,00%	0,52%
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	574	4.684	2.688.632	4.320	2.479.526	0,00%	0,61%

CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	517	4.145	2.143.022	4.328	2.237.686	0,00%	0,55%
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	611	5.391	3.293.600	4.600	2.810.824	0,00%	0,70%
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	362	5.403	1.955.754	6.408	2.319.578	0,00%	0,57%
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	248	9.755	2.419.283	8.123	2.014.593	0,00%	0,50%
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	485	4.185	2.029.774	4.680	2.269.950	0,00%	0,56%
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	429	4.752	2.038.433	4.159	1.784.406	0,00%	0,44%
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.551	1.490	2.310.959	1.165	1.806.444	0,00%	0,45%
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	270	8.821	2.381.646	9.335	2.520.393	0,00%	0,62%
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	750	3.083	2.312.236	2.815	2.110.935	0,00%	0,52%
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	34	43.860	1.491.235	44.065	1.498.196	0,00%	0,37%
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	230	8.919	2.051.283	9.142	2.102.573	0,00%	0,52%
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	433	5.771	2.498.743	6.195	2.682.623	0,00%	0,66%
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	141	15.839	2.233.254	17.155	2.418.835	0,00%	0,60%
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	520	2.422	1.259.359	2.319	1.206.008	0,00%	0,30%
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	390	1.756	684.864	1.623	633.069	0,00%	0,16%
US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	300	1.919	575.695	2.460	737.862	0,00%	0,18%
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	196	7.427	1.455.642	7.052	1.382.192	0,00%	0,34%
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	632	3.616	2.285.317	3.649	2.306.361	0,00%	0,57%
US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	250	4.916	1.228.935	4.853	1.213.330	0,00%	0,30%
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	690	2.968	2.048.110	3.157	2.178.075	0,00%	0,54%
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	410	4.863	1.993.657	4.937	2.024.238	0,00%	0,50%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	591	3.358	1.984.686	2.967	1.753.505	0,00%	0,43%
US9078181081 - UNION PACIFIC CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	256	4.408	1.128.570	5.345	1.368.294	0,00%	0,34%
US9182041080 - VF CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	220	3.509	772.047	3.072	675.771	0,00%	0,17%
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	750	2.678	2.008.263	2.849	2.136.479	0,00%	0,53%
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	648	3.007	1.948.827	2.427	1.572.475	0,00%	0,39%
Приоритетни акции	21	42.781	898.409	42.598	894.548	0,00%	0,22%
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	21	42.781	898.409	42.598	894.548	0,00%	0,22%
Акции во затворени инвестициони фондови							

Вкупно вложувања во акции издадени во странство			54.184.842		53.239.636		13,18%
Вкупно вложувања во акции			108.935.168		108.336.944		26,82%

(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	10.178.061	8,33%	2,52%
MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	76.811	4.535.124	4.682.281	4,27%	1,16%
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	21.504	1.276.380	1.304.867	0,36%	0,32%
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	40.540	2.395.732	2.439.345	0,59%	0,60%
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	313.295	18.439.438	18.623.943	2,61%	4,61%
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	43.683	2.489.385	2.526.908	0,79%	0,63%
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	63.113	3.637.485	3.674.177	1,05%	0,91%
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	41.882	2.357.855	2.438.207	0,46%	0,60%
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	227.016	13.069.867	13.076.208	2,84%	3,24%
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	380.787	21.943.275	21.933.540	4,45%	5,43%
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	140.000	8.022.296	8.053.386	1,17%	1,99%
MKMINF20G259 - DO2012/01-0317 26.3.2017 0:0:0 - EUR	32.521	1.976.762	2.055.901	0,79%	0,51%
MKMINF20G267 - DO2012/02-0617 25.6.2017 0:0:0 - EUR	48.686	2.917.987	3.037.088	0,26%	0,75%
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	97.549	6.086.888	6.325.605	4,76%	1,57%
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	16.260	1.010.434	1.050.061	0,32%	0,26%
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	48.785	3.021.886	3.140.399	0,59%	0,78%

MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	65.033	4.050.299	4.182.243	0,92%	1,04%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	48.763	3.013.586	3.111.758	2,02%	0,77%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	19.460	1.199.516	1.238.592	0,39%	0,31%
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	64.846	3.964.691	4.095.504	1,40%	1,01%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	97.274	5.898.563	6.095.451	2,73%	1,51%
MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	102.137	6.752.022	6.932.681	6,67%	1,72%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	64.975	3.933.398	4.064.992	2,50%	1,01%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	81.066	4.894.268	5.058.621	1,18%	1,25%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	97.498	5.836.597	6.052.071	2,33%	1,50%
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	64.861	3.964.291	4.077.431	0,49%	1,01%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	81.242	4.936.776	5.060.078	0,00%	1,25%
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	64.834	3.921.101	4.019.544	2,06%	1,00%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	64.834	3.910.531	4.024.053	0,64%	1,00%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	24.313	1.500.405	1.529.870	1,20%	0,38%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	24.314	1.500.405	1.527.426	1,00%	0,38%
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	162.092	10.002.700	10.101.046	12,50%	2,50%
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	48.787	3.000.810	3.015.802	1,95%	0,75%
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	56.906	3.500.945	3.503.535	1,56%	0,87%
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	65.047	4.001.080	4.001.561	1,10%	0,99%
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		182.943.350	186.232.236		46,10%
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	2.554.174	0,00%	0,63%
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 GOVT 15.5.2026 0:0:0 - USD	50.000	2.811.489	2.763.250	0,00%	0,68%
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		5.278.526	5.317.424		1,32%
Вкупно инвестиции во обврзници		188.221.876	191.549.660		47,42%

(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					
Сертификат и 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	949	5.395.750	5.378.255	0,00%	1,33%
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	325	1.806.300	1.775.919	0,00%	0,44%
US4642865251 - EDGE ISHARES MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.730	6.755.745	7.223.459	0,01%	1,79%
US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	440	583.216	582.574	0,00%	0,14%

US4642867562 - ISHARES INC MSCI SWEDEN ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.100	3.291.832	3.345.534	0,02%	0,83%
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	600	956.223	881.883	0,00%	0,22%
US4642868065 - ISHARES INC.- MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.010	2.927.944	2.893.725	0,00%	0,72%
US4642868487 - ISHARES MSCI JAPAN INDEX - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	9.840	6.552.730	6.762.290	0,00%	1,67%
US4642868552 - ISHARES INC - MSCI ITALY CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.070	790.957	646.199	0,00%	0,16%
US4642872422 - ISHARES TR IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	200	1.285.449	1.350.117	0,00%	0,33%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	557	2.998.286	3.379.428	0,01%	0,84%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.180	2.252.428	2.522.016	0,00%	0,62%
US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.110	1.131.054	1.108.339	0,01%	0,27%
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.366	5.844.492	5.990.814	0,02%	1,48%
US9229083632 - THE VANGUARD GROUP - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.025	10.890.622	11.160.947	0,00%	2,76%
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		53.463.025	55.001.500		13,62%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		53.463.025	55.001.500		13,62%

(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	3.000.317	3.007.780	0,74%
Долгорочни депозити	44.400.000	44.624.578	11,05%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	47.400.317	47.632.358	11,79%

7. Структура на инвестициите на ОДФФ НЛБ Пензија плус во видови на финансиски средства на ден 30.09.2016

ОПИС	Вкупна вредност на денот на известувањето (во денари)	Процентуален удел во вредноста на пензискиот фонд
Акции	108.336.944	26,82%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	191.549.660	47,42%
Краткорочни хартии од вредност	0	0,00%
Акции и удели во инвестициони фондови	55.001.500	13,62%
Парични средства	1.418.600	0,35%
Пласмани и депозити	47.632.358	11,79%
Останати средства	36.407	0,01%
Вкупно средства	403.975.470	100,00%

8. Извештај за реализирани добивки и загуби на ОДФФ НЛБ Пензија плус за период 01.01.- 30.09.2016

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	60	445.605	421.872	-23.733
08.06.2016	US4370761029 - HD	60	445.605	421.872	-23.733
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	6.713	9.776.839	9.742.042	-34.797
16.03.2016	US4642862100 - NYXU	100	250.133	255.461	5.328
17.03.2016	US4642862100 - NYXU	100	250.133	262.078	11.944
28.03.2016	US4642862100 - NYXU	100	250.133	258.039	7.905
31.03.2016	US4642862100 - NYXU	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				-58.530

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

9. Извештај за нереализирани добивки и загуби на ОДФ НЛБ Пензија плус за период 1.1.- 30.09.2016

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	54.750.326	55.097.308	0	346.983	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИДАД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.524.589	7.525.045	0	456	0	0	0
	МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	605.280	657.856	0	52.576	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.077.070	7.605.106	0	528.036	0	0	0
	МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	5.705.099	5.463.180	0	-241.919	0	0	0
	МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.497.590	8.661.171	0	-836.419	0	0	0
	МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.826.250	3.280.000	0	453.750	0	0	0
	МКРРИV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.531.589	8.174.059	0	642.470	0	0	0
	МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.563.000	6.720.000	0	157.000	0	0	0
	МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.920.259	3.645.891	0	-274.368	0	0	0
	МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.499.600	3.365.000	0	-134.600	0	0	0
	Приоритетни акции издадени во Република Македонија							
	Акции во затворени инвестициони фондови и издадени во Република Македонија							
	Обични акции издадени од странски компании и банки	53.286.433	52.345.088	0	-941.345	0	0	0
	BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.064.605	2.100.869	0	36.264	0	0	0
	CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.688.632	2.479.526	0	-209.106	0	0	0
	CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.143.022	2.237.686	0	94.665	0	0	0

DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.293.600	2.810.824	0	-482.777	0	0	0
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.955.754	2.319.578	0	363.825	0	0	0
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.419.283	2.014.593	0	-404.690	0	0	0
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.029.774	2.269.950	0	240.175	0	0	0
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.038.433	1.784.406	0	-254.027	0	0	0
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.310.959	1.806.444	0	-504.515	0	0	0
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.381.646	2.520.393	0	138.747	0	0	0
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.312.236	2.110.935	0	-201.301	0	0	0
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.491.235	1.498.196	0	6.961	0	0	0
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.051.283	2.102.573	0	51.290	0	0	0
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.498.743	2.682.623	0	183.880	0	0	0
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.233.254	2.418.835	0	185.581	0	0	0
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.259.359	1.206.008	0	-53.351	0	0	0
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	684.864	633.069	0	-51.796	0	0	0
US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	575.695	737.862	0	162.167	0	0	0
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.455.642	1.382.192	0	-73.451	0	0	0
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.285.317	2.306.361	0	21.044	0	0	0
US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.228.935	1.213.330	0	-15.606	0	0	0
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.048.110	2.178.075	0	129.964	0	0	0
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.993.657	2.024.238	0	30.581	0	0	0
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.984.686	1.753.505	0	-231.181	0	0	0
US9078181081 - UNION PACIFIC CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.128.570	1.368.294	0	239.723	0	0	0
US9182041080 - VF CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	772.047	675.771	0	-96.277	0	0	0
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.008.263	2.136.479	0	128.216	0	0	0
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.948.827	1.572.475	0	-376.352	0	0	0
Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	898.409	894.548	0	-3.862	0	0	0

	US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	898.409	894.548	0	-3.862	0	0	0
	Акции во затворени инвестициони фондови и издадени од странски компании и банки							
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	182.943.350	186.232.236	-1.383.585	0	-281.079	4.953.549	0
	MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	9.980.572	10.178.061	0	0	0	197.489	0
	MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	4.535.124	4.682.281	-53.174	0	514	199.816	0
	MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	1.276.380	1.304.867	-7.251	0	-1.786	37.525	0
	MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	2.395.732	2.439.345	-27.409	0	-2.473	73.495	0
	MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	18.439.438	18.623.943	-382.265	0	-22.566	589.337	0
	MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	2.489.385	2.526.908	-44.439	0	-3.755	85.717	0
	MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	3.637.485	3.674.177	-58.660	0	-6.199	101.551	0
	MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	2.357.855	2.438.207	8.919	0	-3.336	74.768	0
	MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	13.069.867	13.076.208	-305.728	0	-20.028	332.097	0
	MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	21.943.275	21.933.540	-496.541	0	-32.975	519.781	0
	MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	8.022.296	8.053.386	-17.037	0	-26.419	74.546	0
	MKMINF20G259 - DO2012/01-0317 26.3.2017 0:0:0 - EUR	1.976.762	2.055.901	0	0	-3.237	82.376	0
	MKMINF20G267 - DO2012/02-0617 25.6.2017 0:0:0 - EUR	2.917.987	3.037.088	0	0	-4.776	123.876	0
	MKMINF20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	6.086.888	6.325.605	0	0	-10.493	249.210	0
	MKMINF20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	1.010.434	1.050.061	0	0	-1.742	41.369	0
	MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	3.021.886	3.140.399	0	0	-5.209	123.722	0
	MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	4.050.299	4.182.243	0	0	-6.924	138.868	0
	MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	3.013.586	3.111.758	0	0	-5.152	103.323	0
	MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.199.516	1.238.592	0	0	-2.051	41.126	0
	MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	3.964.691	4.095.504	0	0	-6.483	137.295	0
	MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	5.898.563	6.095.451	0	0	-9.645	206.532	0
	MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	6.752.022	6.932.681	0	0	-10.944	191.603	0
	MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	3.933.398	4.064.992	0	0	-6.434	138.029	0
	MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	4.894.268	5.058.621	0	0	-8.009	172.361	0

MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	5.836.597	6.052.071	0	0	-10.472	225.947	0
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	3.964.291	4.077.431	0	0	-6.483	119.623	0
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	4.936.776	5.060.078	0	0	-8.072	131.375	0
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	3.921.101	4.019.544	0	0	-6.560	105.003	0
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	3.910.531	4.024.053	0	0	-6.564	120.087	0
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.500.405	1.529.870	0	0	-4.934	34.399	0
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	1.500.405	1.527.426	0	0	-4.904	31.926	0
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	10.002.700	10.101.046	0	0	-32.440	130.786	0
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	3.000.810	3.015.802	0	0	87	14.905	0
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	3.500.945	3.503.535	0	0	-638	3.228	0
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	4.001.080	4.001.561	0	0	20	461	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	5.278.526	5.317.424	72.448	0	-43.917	10.367	0
FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26 CORP 25.5.2026 0:0:0 - EUR	2.467.037	2.554.174	90.582	0	-8.044	4.599	0
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 GOVT 15.5.2026 0:0:0 - USD	2.811.489	2.763.250	-18.134	0	-35.873	5.768	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							
Сертификат и 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	53.463.025	55.001.500	0	1.538.475	0	0	0	
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	5.395.750	5.378.255	0	-17.494	0	0	0	
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.806.300	1.775.919	0	-30.381	0	0	0	
US4642865251 - EDGE ISHARES MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	6.755.745	7.223.459	0	467.715	0	0	0	
US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	583.216	582.574	0	-642	0	0	0	
US4642867562 - ISHARES INC MSCI SWEDEN ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.291.832	3.345.534	0	53.702	0	0	0	
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	956.223	881.883	0	-74.339	0	0	0	
US4642868065 - ISHARES INC.- MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.927.944	2.893.725	0	-34.219	0	0	0	
US4642868487 - ISHARES MSCI JAPAN INDEX - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	6.552.730	6.762.290	0	209.561	0	0	0	
US4642868552 - ISHARES INC - MSCI ITALY CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	790.957	646.199	0	-144.757	0	0	0	
US4642872422 - ISHARES TR IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.285.449	1.350.117	0	64.668	0	0	0	
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.998.286	3.379.428	0	381.142	0	0	0	
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.252.428	2.522.016	0	269.588	0	0	0	
US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.131.054	1.108.339	0	-22.715	0	0	0	
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	5.844.492	5.990.814	0	146.322	0	0	0	

	US9229083632 - THE VANGUARD GROUP - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	10.890.622	11.160.947	0	270.325	0	0	0
	Други ненаведени хартии од вредност издадени од странски влади и компании							
	ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	350.620.069	354.888.104	-1.311.136	940.251	-324.996	4.963.916	0

Забелешка: Вкупната разлика помеѓу објективната (фер) вредност и трошокот на набавка е еднаква вкупно нерелизираните 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	1.418.600	0	0	0	0	0	1.418.600
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	163.338.444	0	163.338.444
3) Финансиски инструменти расположлив и за продавање	0	0	0	0	0	159.768.936	159.768.936
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	21.641	166.232	31.900.000	0	0	47.325.210	79.413.082
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	36.407	0	36.407
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	1.440.241	166.232	31.900.000	0	163.374.852	207.094.145	403.975.470
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	2.768.941	0	2.768.941
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	2.768.941	0	2.768.941
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	1.440.241	166.232	31.900.000	0	160.605.911	207.094.145	401.206.529

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	4,14	1,60	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	3,38	4,22	0,00	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	1.418.600	0	0	0	1.418.600
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	163.338.444	0	0	0	163.338.444
3) Финансиски инструменти расположлив и за продавање	159.768.936	0	0	0	159.768.936
4) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	31.611	3.200.747	44.400.000	31.780.724	79.413.082
5) Останати средства на пензискиот фонд	36.407	0	0	0	36.407
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	324.593.999	3.200.747	44.400.000	31.780.724	403.975.470
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	2.768.941	0	0	0	2.768.941
8) Вкупно обврски (6+7)	2.768.941	0	0	0	2.768.941
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	321.825.058	3.200.747	44.400.000	31.780.724	401.206.529
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	321.825.058	325.025.805	369.425.805	401.206.529	

Обелоденувања поврзани со ризикот на девизните курсеви

	Валутна структура на средствата и обврските					
	МКД	EUR	USD	GBP	Други	Вкупно
Средства						
1) Пари и депозити кај банки	1.416.529	0	2.072	0	0	1.418.600
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	55.097.308	25.116.247	78.407.677	0	4.717.213	163.338.444
3) Финансиски инструменти расположливи и за продавање	10.178.061	146.827.625	2.763.250	0	0	159.768.936
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	47.632.027	31.781.055	0	0	0	79.413.082
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	36.407	-	0	36.407
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	114.323.925	203.724.927	81.209.405	0	4.717.213	403.975.470
Обврски	2.758.019	0	10.922	0	0	2.768.941

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