



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен задолжителен пензиски

фонд НЛБ Пензиски фонд

За период од 01.01. до 31.12. 2016 година



NLB

Нов пензиски фонд

Содржина

1.	Извештај за нето средства на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд	3
2.	Извештај за работењето на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд	4
3.	Извештај за промени на нето средства на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд	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 ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд	15
8.	Извештај за реализирани добивки и загуби	16
9.	Извештај за нереализирани добивки и загуби	19

1. Извештај за нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд 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	32.845	24
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		701	8.293
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ	4	375.990	35.974
5	14	Побарувања од други пензиски фондови		0	0
6	15	Побарувања за дадени аванси		0	0
7	16	Побарувања од пензиските друштва или чуварот на имот		0	0
8	17	Побарувања од државата и други институции		0	0
9	18	Побарувања за хартии од вредност купени директно од издавачот		0	0
10	19	Платени трошоци за идните периоди и недостасана наплата на приходи (АВР)		0	0
11		Вложувања во хартии од вредност и депозити (12+13+14)	5	18.215.690	22.326.813
12	3	Финансиски средства кои се чуваат за тргување		5.585.535	6.493.148
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		9.020.774	9.215.566
14	5	Финансиски средства кои се чуваат до достасување		3.609.381	6.618.099
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		18.625.226	22.371.104
16	20	Обврски за неконвертирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		27.575	0
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		16	4
19	23	Обврски за пренос на средства на други пензиски фондови по основ на промена на членство		0	0
20	24	Краткорочни обврски за заеми и кредити		0	0
21	25	Долгорочни обврски за заеми и кредити		0	0
22	26	Обврски кон пензиското друштво	6	19.617	9.955
23	27	Обврски за брокерски и посреднички провизии		0	0
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		15	2.345
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		47.223	12.304
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		18.578.003	22.358.800
28		Број на издадени сметководствени единици		109.158.109,878653	124.373.763,124997
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		170,193521	179,771032
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		14.520.873	17.171.880
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		50.384	53.638
32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-37.642	-58.656
33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-166.552	-182.217

34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		937.761	1.185.015
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		3.260.126	4.197.887
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	7	13.053	-8.747
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		18.578.003	22.358.800

2. Извештај за работењето на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд на 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	8	566.033	619.734
2	71	Приходи од дивиденди	9	110.342	125.011
3	73	Реализирани капитални добивки	10	128.090	59.577
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		76.383	61.627
5	75	Други неспоменати приходи	11	1.267	1.374
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		882.115	867.323
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	12	82.221	96.511
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	13	38.922	23.345
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		70.718	55.688
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	14	1.858	989
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		1.421	0
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		195.140	176.533
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		686.975	690.790
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	15	242.205	504.681
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		8.581	-10.456
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		250.786	494.225
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		937.761	1.185.015

3. Извештај за промени на нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд 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 РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
1	Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	686.975	690.790
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	250.786	494.225
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	-2.076	-21.800
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	935.685	1.163.215
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	2.339.134	2.651.007
6	91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	2.601	3.254
7	92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-10.689	-21.014
8	93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-10.810	-15.665
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	2.320.236	2.617.582
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	3.255.921	3.780.797
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	15.322.081	18.578.003
12		На крајот на периодот (10+11)	18.578.003	22.358.800
		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	13.944.352,911463	15.410.033,687276
14		Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	15.477,366899	18.750,770702
15		Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-63.611,550447	-121.931,188873
16		Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-63.876,131212	-91.200,022761
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	13.832.342,596703	15.215.653,246344

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	15.322.081	18.578.003
2	Број на сметководствени единици на почетокот на периодот	95.325.767,281950	109.158.109,878653
3	Вредност на сметководствената единица на почетокот на периодот (1/2)	160,733889	170,193521
	Вредноста на нето средствата на пензискиот фонд по сметководствена единица на крајот на периодот		
4	Нето средства на пензискиот фонд на крајот на периодот	18.578.003	22.358.800
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	109.158.109,878653	124.373.763,124997
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	170,193521	179,771032
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,004873	0,004809
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,039812	0,034072
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	7,87%	6,34%

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

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

17.255.480

20.274.637

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 2016 и 2015 година е номинален седумгодишен принос сведен на годишно ниво пресметан согласно Законската регулатива за тој извештаен период.

Реалниот седумгодишен принос сведен на годишно ниво изнесува 4,74% за 2016, односно 6,45% за 2015 година.

**5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОЗПФ НЛБ
Пензиски фонд 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	109.158.109,878653	14.367.063
2	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	15.410.033,687276	2.651.007
3	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство во текот на периодот	18.750,770702	3.254
4	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-121.931,188873	-21.014
5	Повлечени сметководствени единици врз основа на пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-91.200,022761	-15.665
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	124.373.763,124997	16.984.645
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		170,193521
	На крајот на периодот		179,771032

6. Извештај за структура на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд 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							
МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	46.418	5.444	252.698.504	5.387	250.060.265	3,24%	1,12%
МКФЕРS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	561	37.830	21.222.630	42.000	23.562.000	3,12%	0,11%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	212.968	490	104.354.320	580	123.521.440	6,93%	0,55%
МККМBS101019 - КОМЕРЦИЈАЛНА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.546	2.295	15.025.296	2.854	18.685.361	0,29%	0,08%
МКМТSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	440.503	289	127.362.056	260	114.530.780	0,46%	0,51%
МКМТУР101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	39.222	3.850	151.004.700	3.699	145.072.373	8,68%	0,65%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.720	2.678	23.352.594	3.812	33.240.640	1,99%	0,15%
МКРРIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.688	28.234	47.658.158	34.500	58.236.000	4,22%	0,26%
МКРЕPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.700	41.019	69.731.995	43.000	73.100.000	6,54%	0,33%
МКТЕТЕ101016 - ТЕТЕКС АД ТЕТОВО - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.697	645	6.899.565	935	10.001.695	2,58%	0,04%
МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.602	8.968	14.366.587	8.755	14.025.510	2,08%	0,06%
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.010	2.600	15.626.000	2.300	13.823.000	2,23%	0,06%
МКЗРКО101012 - ЗК ПЕЛАГОНИЈА АД БИТОЛА - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.370	1.600	5.392.000	2.500	8.425.000	1,66%	0,04%
Приоритетни акции							

Акции во затворени инвестициони фондови								
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			854.694.404			886.284.063		3,96%
Обични акции								
BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.680	6.918	101.559.019	6.182	90.750.801	0,00%	0,41%	
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	24.541	4.563	111.980.086	4.242	104.109.171	0,00%	0,47%	
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	20.159	4.184	84.350.586	4.182	84.307.795	0,00%	0,38%	
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	18.950	5.433	102.962.023	5.456	103.399.851	0,00%	0,46%	
DE0006048408 - HENKEL AG & CO. KGAA ST - ОБИЧНИ АКЦИИ	12.500	5.459	68.231.529	6.085	76.067.615	0,00%	0,34%	
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	12.860	5.536	71.194.653	7.181	92.347.713	0,00%	0,41%	
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.471	9.414	98.570.130	9.653	101.071.834	0,00%	0,45%	
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	20.670	4.224	87.311.897	5.429	112.225.797	0,00%	0,50%	
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	20.056	4.707	94.398.158	4.728	94.822.848	0,00%	0,42%	
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	72.608	1.424	103.391.721	1.475	107.069.687	0,00%	0,48%	
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.299	8.869	82.470.075	11.153	103.708.861	0,00%	0,46%	
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	28.010	3.063	85.794.246	3.723	104.272.453	0,00%	0,47%	
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.610	43.860	70.614.354	46.220	74.414.651	0,00%	0,33%	
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	440	44.991	19.796.231	43.737	19.244.178	0,00%	0,09%	
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.550	9.028	86.221.319	8.528	81.440.635	0,00%	0,36%	
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	16.212	5.791	93.877.191	6.755	109.516.829	0,00%	0,49%	
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	5.325	16.025	85.333.499	16.540	88.075.662	0,00%	0,39%	
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	30.350	2.429	73.719.231	2.418	73.391.996	0,00%	0,33%	
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	37.200	1.756	65.325.527	1.843	68.563.144	0,00%	0,31%	
US4062161017 - HALLIBURTON COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	23.300	1.919	44.712.341	3.155	73.507.831	0,00%	0,33%	
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.340	7.434	69.434.338	7.820	73.041.819	0,00%	0,33%	

US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	21.914	3.648	79.951.659	5.033	110.291.700	0,00%	0,49%
US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	17.200	4.747	81.648.971	4.461	76.735.056	0,01%	0,34%
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	29.630	3.052	90.437.599	3.624	107.389.941	0,00%	0,48%
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	16.620	5.202	86.464.627	6.822	113.378.076	0,00%	0,51%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	31.880	3.280	104.577.205	3.238	103.235.360	0,00%	0,46%
US9182041080 - V.F. CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	11.650	3.509	40.883.420	3.112	36.251.089	0,00%	0,16%
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	32.800	2.676	87.761.370	3.113	102.120.543	0,00%	0,46%
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	28.925	3.044	88.061.799	3.214	92.974.635	0,00%	0,42%
Приоритетни акции							
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	1.163	42.781	49.754.774	45.017	52.354.793	0,00%	0,23%
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			2.410.789.577		2.630.082.364		11,76%
Вкупно вложувања во акции			3.265.483.981		3.516.366.427		15,72%

(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					
MKMINF20G291 - DO2012/05-0817 9.8.2017 0:0:0 - MKD	1.045.000.000	1.008.463.824	1.068.139.141	88,71%	4,77%
MKMINF20G499 - DO2013/01-0118 9.1.2018 0:0:0 - MKD	185.000.000	184.735.751	195.111.011	100,00%	0,87%
MKMINF20G507 - DO2013/03-0118 24.1.2018 0:0:0 - MKD	60.000.000	59.789.176	63.001.139	100,00%	0,28%
MKMINF20GA71 - DO2014/25-1019 16.10.2019 0:0:0 - MKD	70.000.000	67.844.252	70.576.198	5,81%	0,32%
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	240.000.000	239.507.752	245.867.670	96,00%	1,10%
MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	408.659	24.013.991	25.178.245	22,70%	0,11%
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	271.437	16.158.433	16.550.175	4,52%	0,07%
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	580.435	34.381.128	35.229.980	8,41%	0,16%
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	1.654.445	96.967.228	99.410.910	13,79%	0,44%
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	1.025	58.163	61.173	0,02%	0,00%

MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	1.882	108.016	111.296	0,03%	0,00%
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	688.798	38.331.938	40.515.550	7,57%	0,18%
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	1.439.371	82.833.359	84.222.281	17,99%	0,38%
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	1.752.900	101.008.501	102.029.038	20,50%	0,46%
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	3.328.441	190.756.680	192.703.153	27,74%	0,86%
MKMINF20G259 - DO2012/01-0317-DK 26.3.2017 0:0:0 - EUR	3.252.133	197.663.879	208.331.466	79,21%	0,93%
MKMINF20G267 - DO2012/02-0617-DK 25.6.2017 0:0:0 - EUR	1.136.017	68.079.379	71.808.797	6,06%	0,32%
MKMINF20G325 - DO2012/07-0817-DK 16.8.2017 0:0:0 - EUR	8.536.516	507.563.216	535.503.311	56,76%	2,39%
MKMINF20G341 - DO2012/09-0917-DK 6.9.2017 0:0:0 - EUR	1.804.834	106.973.160	112.875.157	30,58%	0,50%
MKMINF20G358 - DO2012/10-0917-DK 20.9.2017 0:0:0 - EUR	2.438.826	144.231.815	152.210.983	14,44%	0,68%
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017-DK 4.10.2017 0:0:0 - EUR	1.950.982	115.134.193	121.515.600	95,24%	0,54%
MKMINF20G390 - DO2012/14-1017-DK 18.10.2017 0:0:0 - EUR	1.951.128	114.893.362	121.275.809	92,66%	0,54%
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117-DK 1.11.2017 0:0:0 - EUR	1.951.178	114.639.010	121.030.588	38,19%	0,54%
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117-DK 23.11.2017 0:0:0 - EUR	6.862.391	401.813.600	424.283.897	83,51%	1,90%
MKMINF20G481 - DO2013/02-0118-DK 9.1.2018 0:0:0 - EUR	7.007.560	431.019.113	453.529.692	18,50%	2,03%
MKMINF20G523 - DO2013/05-0218-DK 28.2.2018 0:0:0 - EUR	973.762	59.469.928	62.450.268	11,17%	0,28%
MKMINF20G549 - DO2013/07-0318-DK 7.3.2018 0:0:0 - EUR	1.297.421	79.152.392	83.125.609	100,00%	0,37%
MKMINF20G556 - DO2013/08-0318-DK 14.3.2018 0:0:0 - EUR	1.459.066	88.923.979	93.392.379	84,91%	0,42%
MKMINF20G572 - DO2013/10-0418-DK 4.4.2018 0:0:0 - EUR	1.297.526	78.839.471	82.813.308	31,77%	0,37%
MKMINF20G580 - DO2013/11-0418-DK 25.4.2018 0:0:0 - EUR	973.394	59.011.877	61.844.392	35,29%	0,28%
MKMINF20G606 - DO2013/13-0518-DK 30.5.2018 0:0:0 - EUR	2.920.182	176.184.962	184.684.562	70,18%	0,83%
MKMINF20G671 - DO2013/20-0718DK 18.7.2018 0:0:0 - EUR	1.945.368	116.801.495	122.091.223	44,77%	0,55%
MKMINF20G705 - DO2013/23-0718DK 25.7.2018 0:0:0 - EUR	973.457	58.394.793	61.039.885	34,71%	0,27%
MKMINF20G721 - DO2013/25-0818DK 30.8.2018 0:0:0 - EUR	3.008.345	179.626.108	187.801.147	45,65%	0,84%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	3.901.963	231.958.869	242.566.023	55,22%	1,08%
MKMINF20G762 - DO2013/29-1018DK 17.10.2018 0:0:0 - EUR	975.589	57.893.201	60.544.667	46,86%	0,27%
MKMINF20G770 - DO2013/30-1018DK 31.10.2018 0:0:0 - EUR	1.300.760	77.049.319	80.587.241	53,69%	0,36%
MKMINF20G788 - DO2013/31-1118DK 21.11.2018 0:0:0 - EUR	2.276.116	134.464.917	140.650.268	57,38%	0,63%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	1.462.898	86.268.479	90.243.630	60,65%	0,40%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.621.644	95.372.225	99.778.902	32,11%	0,45%
MKMINF20G838 - DO2014/01-0119DK 23.1.2019 0:0:0 - EUR	1.621.771	99.602.385	104.017.290	25,41%	0,47%
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	729.513	44.602.121	46.588.463	15,74%	0,21%
MKMINF20G903 - DO2014/08-0319DK 27.3.2019 0:0:0 - EUR	486.265	29.623.569	30.947.730	24,27%	0,14%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	2.431.844	147.457.170	154.082.959	68,34%	0,69%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	1.461.929	88.499.704	92.482.387	56,25%	0,41%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	4.863.947	293.617.067	306.878.280	70,96%	1,37%
MKMINF20G960 - DO2014/14-0619DK 19.6.2019 0:0:0 - EUR	972.763	58.619.928	61.271.167	32,17%	0,27%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	3.493.685	210.507.325	220.721.413	83,66%	0,99%
MKMINF20GA06 - DO2014/18-0824DK 21.8.2024 0:0:0 - EUR	1.219.685	73.034.758	76.619.448	12,51%	0,34%
MKMINF20GA14 - DO2014/19-0924DK 4.9.2024 0:0:0 - EUR	813.169	48.391.660	50.801.775	79,37%	0,23%
MKMINF20GA30 - DO2014/21-1017DK 2.10.2017 0:0:0 - EUR	810.985	48.820.542	50.340.626	12,77%	0,23%
MKMINF20GA89 - DO2014/26-1019DK 16.10.2019 0:0:0 - EUR	5.352.407	331.664.071	333.020.212	43,54%	1,49%
MKMINF20GC79 - DO2015/05-0230DK 12.2.2030 0:0:0 - EUR	2.113.649	129.586.918	134.563.347	61,90%	0,60%
MKMINF20GD03 - DO2015/08-0230DK 26.2.2030 0:0:0 - EUR	813.011	49.766.637	51.680.935	58,82%	0,23%

MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	4.215.947	257.637.660	267.567.634	31,74%	1,20%
MKMINF20GD52 - DO2015/13-0330DK 26.3.2030 0:0:0 - EUR	972.578	59.346.003	61.636.584	18,78%	0,28%
MKMINF20GD78 - DO2015/15-0430DK 16.4.2030 0:0:0 - EUR	2.759.037	167.964.121	174.458.378	61,92%	0,78%
MKMINF20GD94 - DO2015/17-0530DK 7.5.2030 0:0:0 - EUR	1.462.088	88.805.710	92.249.819	35,94%	0,41%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	2.924.727	177.705.886	183.691.688	88,80%	0,82%
MKMINF20GE36 - DO2015/21-0625DK 25.6.2025 0:0:0 - EUR	1.945.052	117.789.773	121.770.190	0,00%	0,54%
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	3.079.626	186.231.189	192.528.763	97,94%	0,86%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	3.079.626	185.728.777	192.978.313	30,22%	0,86%
MKMINF20GE93 - DO2015/27-0725DK 23.7.2025 0:0:0 - EUR	2.269.287	137.059.962	141.690.063	3,24%	0,63%
MKMINF20GF27 - DO2015/30-0825DK 6.8.2025 0:0:0 - EUR	1.137.601	68.618.895	70.939.278	100,00%	0,32%
MKMINF20GF76 - DO2015/35-0825DK 27.8.2025 0:0:0 - EUR	1.951.457	117.468.114	121.449.226	88,89%	0,54%
MKMINF20GG34 - DO2015/41-1030DK 29.10.2030 0:0:0 - EUR	4.378.319	260.767.342	271.066.089	90,00%	1,21%
MKMINF20GH09 - DO2016/02-0131DK 14.1.2031 0:0:0 - EUR	1.623.703	100.027.000	103.698.080	5,07%	0,46%
MKMINF20GH17 - DO2016/03-0131DK 22.1.2031 0:0:0 - EUR	2.431.374	150.033.999	155.562.047	63,03%	0,70%
MKMINF20GH74 - DO2016/07-0231DK 11.2.2031 0:0:0 - EUR	1.134.606	70.018.900	72.429.212	11,35%	0,32%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.945.077	120.032.399	123.668.077	96,00%	0,55%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	2.431.382	150.034.000	154.331.954	100,00%	0,69%
MKMINF20GI24 - DO2016/12-0431DK 14.4.2031 0:0:0 - EUR	1.378.565	85.022.951	87.366.916	70,83%	0,39%
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	1.296.737	80.021.600	81.652.494	100,00%	0,37%
MKMINF20GI81 - DO2016/18-0826DK 18.8.2026 0:0:0 - EUR	2.276.712	140.034.000	141.900.551	90,52%	0,63%
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	2.276.712	140.033.999	142.203.857	90,91%	0,64%
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	2.276.230	140.012.000	141.579.879	62,22%	0,63%
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	5.691.640	350.012.000	353.712.590	95,89%	1,58%
MKMINF20GJ64 - DO2016/26-1131DK 3.11.2031 0:0:0 - EUR	4.385.032	270.012.000	271.417.586	70,13%	1,21%
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	4.366.085	268.452.001	269.374.073	57,73%	1,20%
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	11.655.480	716.661.500	717.348.259	82,37%	3,21%
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		12.185.706.572	12.636.973.396		56,49%
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	1.000.000	61.675.917	61.062.740	0,01%	0,27%
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 GOVT 15.5.2026 0:0:0 - USD	3.000.000	165.842.402	163.391.038	0,00%	0,73%
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		227.518.318	224.453.778		1,00%
Вкупно инвестиции во обврзници		12.413.224.891	12.861.427.174		57,49%

(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					
МКMINFDYG014 - DZ2016/01-364 11.1.2017 0:0:0 - MKD	150.000.000	146.335.750	149.887.935	15,38%	0,67%
МКMINFDYG022 - DZ2016/02-363 18.1.2017 0:0:0 - MKD	100.000.000	97.472.300	99.873.129	100,00%	0,45%
МКMINFDYG105 - DZ2016/10-364 21.6.2017 0:0:0 - MKD	70.000.000	68.225.850	69.155.988	17,50%	0,31%
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		312.033.901	318.917.052		1,43%
Удели во отворени инвестициони фондови					
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	63.013	354.174.998	388.883.649	0,06%	1,74%
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	23.860	124.088.779	126.473.478	0,10%	0,57%
US4642865251 - EDGE ISHARES MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	62.600	244.456.423	265.113.275	0,28%	1,19%
US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	27.719	36.620.081	39.884.799	0,22%	0,18%
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	112.809	176.960.622	189.034.068	1,05%	0,85%
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	40.620	64.736.268	62.807.333	0,09%	0,28%
US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	95.200	138.770.587	147.033.276	0,06%	0,66%

US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	9.000	57.845.208	61.511.555	0,01%	0,28%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	29.680	163.454.145	190.214.339	0,35%	0,85%
US4642874659 - ISHARES MSCI EAFE ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	21.773	72.112.089	73.312.923	0,00%	0,33%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	71.600	136.672.742	173.476.327	0,27%	0,78%
US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	45.000	45.853.528	47.556.758	0,34%	0,21%
US46434G8226 - BLACK ROCK INC. USA - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	130.100	343.551.025	370.758.796	0,01%	1,66%
US46434G8309 - BLACK ROCK INC. USA - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	23.553	36.488.341	33.258.429	0,04%	0,15%
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	148.516	257.873.012	272.776.284	0,83%	1,22%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	44.450	466.981.743	532.282.971	0,03%	2,38%
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		2.720.639.591	2.974.378.260		13,30%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		3.032.673.492	3.293.295.312		14,72%

(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	465.228.716	465.606.321	2,08%
Долгорочни депозити	2.169.245.196	2.190.118.203	9,79%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	2.634.473.912	2.655.724.524	11,87%

7. Структура на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд во видови на финансиски средства на ден 31.12.2016

ОПИС	Вкупна вредност на денот на извештањето (во денари)	Процентуален удел во вредноста на пензискиот фонд
Акции	3.516.366.427	15,72%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	12.861.427.174	57,49%
Краткорочни хартии од вредност	318.917.051	1,43%
Акции и удели во инвестициони фондови	2.974.378.260	13,30%
Парични средства	23.701	0,00%
Пласмани и депозити	2.655.724.524	11,87%
Останати средства	44.267.317	0,20%
Вкупно средства	22.371.104.455	100,00%

8. Извештај за реализирани добивки и загуби на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд за период 1.1.- 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	104.024	416.978.474	457.073.263	40.094.790
01.06.2016	CH0012005267 - NOVN	3.400	15.800.154	14.957.291	-842.863
10.03.2016	DE0005190003 - BMW	2.500	14.128.518	12.223.765	-1.904.753
05.12.2016	DE0005190003 - BMW	3.000	16.300.056	15.123.957	-1.176.099
08.06.2016	DE0007236101 - SIE	3.500	19.376.461	20.812.620	1.436.159
20.04.2016	DE0008404005 - ALV	1.300	12.766.210	12.193.534	-572.676
14.11.2016	DE0008404005 - ALV	1.700	16.003.173	15.921.670	-81.502
20.04.2016	DE000BASF111 - BAS	2.000	8.448.176	8.621.709	173.533
14.11.2016	FR0000120578 - SAN	3.000	14.120.187	14.242.242	122.055
20.04.2016	FR0000120628 - CS	5.000	7.494.785	6.883.486	-611.299
14.11.2016	FR0000120628 - CS	10.000	14.239.715	13.897.870	-341.845
10.03.2016	FR0000121014 - MC	1.500	13.285.595	14.806.859	1.521.264
05.12.2016	FR0000121014 - MC	1.500	13.303.055	15.921.099	2.618.043
10.03.2016	FR0000131104 - BNP	3.000	9.306.971	8.792.264	-514.707
14.11.2016	FR0000131104 - BNP	5.000	15.314.931	17.090.875	1.775.943
04.08.2016	US0311621009 - AMGN	1.100	9.931.251	10.451.384	520.133
04.08.2016	US0378331005 - AAPL	1.500	8.685.898	8.709.258	23.360
04.08.2016	US09062X1037 - BIIB	750	12.018.803	13.131.420	1.112.617
19.10.2016	US26875P1012 - EOG	10.400	41.503.735	55.385.174	13.881.439
08.06.2016	US3696041033 - GE	13.000	22.828.813	21.383.311	-1.445.503
08.06.2016	US4370761029 - HD	1.200	8.920.900	8.437.433	-483.467
01.06.2016	US46625H1005 - JPM	3.200	11.674.971	11.510.985	-163.986
07.06.2016	US46625H1005 - JPM	500	1.824.214	1.778.119	-46.095
05.12.2016	US46625H1005 - JPM	3.000	10.945.285	14.344.560	3.399.275
04.08.2016	US5949181045 - MSFT	3.500	10.682.808	10.917.860	235.052
14.11.2016	US6934751057 - PNC	2.800	14.566.844	16.428.625	1.861.780
08.06.2016	US9078181081 - UNP	4.000	17.633.912	19.416.642	1.782.730

21.11.2016	US9078181081 - UNP	12.674	55.873.051	73.689.252	17.816.201
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	23.599	0	28.038	28.038
31.05.2016	MKMINF200D50 - RMDEN05	4.195	0	2.364	2.364
31.05.2016	MKMINF200D68 - PMDEN06	8.658	0	8.346	8.346
31.05.2016	MKMINF200D76 - PMDEN07	1.438	0	2.051	2.051
31.05.2016	MKMINF200D84 - PMDEN08	9.307	0	15.277	15.277
	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	1.500	83.673.013	87.959.119	4.286.106
26.01.2016	US912810RN00 - US TREASURY 30	1.500	83.673.013	87.959.119	4.286.106
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	289.142	431.567.507	423.390.847	-8.176.661
16.03.2016	US4642862100 - HXU	6.000	15.007.993	15.327.660	319.667
17.03.2016	US4642862100 - HXU	7.000	17.509.325	18.345.435	836.110
28.03.2016	US4642862100 - HXU	2.142	5.357.853	5.527.185	169.332
31.03.2016	US4642862100 - HXU	11.258	28.159.997	29.087.044	927.047
02.06.2016	US4642867075 - EWQ	16.000	21.837.188	21.758.063	-79.124
07.06.2016	US4642867075 - EWQ	16.000	21.837.188	21.900.597	63.410
02.06.2016	US4642867562 - EWD	9.500	15.087.790	15.420.795	333.006
07.06.2016	US4642867562 - EWD	9.500	15.087.790	15.626.950	539.160
02.06.2016	US4642867646 - EWP	6.000	9.562.226	9.212.791	-349.435
07.06.2016	US4642867646 - EWP	6.000	9.562.226	9.165.113	-397.113
02.06.2016	US4642868065 - EWG	15.000	22.146.683	21.449.979	-696.704
07.06.2016	US4642868065 - EWG	15.000	22.146.683	21.640.756	-505.927
02.06.2016	US4642868552 - EWI	13.750	10.650.534	9.110.030	-1.540.504
07.06.2016	US4642868552 - EWI	13.750	10.650.534	9.231.024	-1.419.509
08.08.2016	US4642868552 - EWI	30.000	23.237.528	18.195.187	-5.042.340
10.08.2016	US4642868552 - EWI	30.000	23.237.528	18.651.696	-4.585.832
02.06.2016	US4642872919 - IXN	4.000	22.028.861	21.882.953	-145.907
07.06.2016	US4642872919 - IXN	142	782.025	775.001	-7.023
08.08.2016	US4642877967 - IYE	6.000	11.453.023	12.644.885	1.191.861
10.08.2016	US4642877967 - IYE	6.000	11.453.023	12.623.201	1.170.178
02.06.2016	US78463X8487 - CWI	17.750	30.819.884	30.429.569	-390.315

07.06.2016	US78463X8487 - CWI	17.750	30.819.884	30.828.292	8.408
16.03.2016	US78464A1512 - IBND	7.700	13.369.753	13.551.262	181.509
17.03.2016	US78464A1512 - IBND	8.000	13.890.652	14.453.303	562.651
28.03.2016	US78464A1512 - IBND	7.500	13.022.486	13.348.106	325.619
31.03.2016	US78464A1512 - IBND	7.400	12.848.853	13.203.970	355.117
	ВКУПНО РЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ				36.232.272

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

9. Извештај за нереализирани добивки и загуби на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд за период 1.1.- 31.12.2016

ХАРТИЈА ОД ВРЕДНОСТ	Трошок за набавка (во денари)	Објективна вредност	Ревалоризација на хартите 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
2	3	4	5	6	7	8	9
Обични акции издадени во Република Македонија	854.694.404	886.284.063	0	31.589.658	0	0	0
МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	252.698.504	250.060.265	0	-2.638.239	0	0	0
МКФЕРS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	21.222.630	23.562.000	0	2.339.370	0	0	0
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	104.354.320	123.521.440	0	19.167.120	0	0	0
МККМBS101019 - КОМЕРЦИЈАЛНА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	15.025.296	18.685.361	0	3.660.065	0	0	0
МКМТSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	127.362.056	114.530.780	0	-12.831.276	0	0	0
МКМТУR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	151.004.700	145.072.373	0	-5.932.328	0	0	0
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	23.352.594	33.240.640	0	9.888.046	0	0	0
МКRPIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	47.658.158	58.236.000	0	10.577.842	0	0	0
МКRPER101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	69.731.995	73.100.000	0	3.368.005	0	0	0
МКТЕТЕ101016 - ТЕТЕКС АД ТЕТОВО - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.899.565	10.001.695	0	3.102.130	0	0	0
МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.366.587	14.025.510	0	-341.077	0	0	0
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	15.626.000	13.823.000	0	-1.803.000	0	0	0
МКZRKO101012 - ЗК ПЕЛАГОНИЈА АД БИТОЛА - ОБИЧНИ АКЦИИ	5.392.000	8.425.000	0	3.033.000	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	2.361.034.803	2.577.727.571	0	216.692.768	0	0	0
BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	101.559.019	90.750.801	0	-10.808.219	0	0	0
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	111.980.086	104.109.171	0	-7.870.915	0	0	0
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	84.350.586	84.307.795	0	-42.791	0	0	0
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	102.962.023	103.399.851	0	437.828	0	0	0
DE0006048408 - HENKEL AG & CO. KGAA ST - ОБИЧНИ АКЦИИ	68.231.529	76.067.615	0	7.836.086	0	0	0
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	71.194.653	92.347.713	0	21.153.061	0	0	0
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	98.570.130	101.071.834	0	2.501.704	0	0	0
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	87.311.897	112.225.797	0	24.913.899	0	0	0
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	94.398.158	94.822.848	0	424.690	0	0	0
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	103.391.721	107.069.687	0	3.677.966	0	0	0
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	82.470.075	103.708.861	0	21.238.787	0	0	0
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	85.794.246	104.272.453	0	18.478.207	0	0	0
US02079K3059 - ALPHABET INC -	70.614.354	74.414.651	0	3.800.298	0	0	0
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	19.796.231	19.244.178	0	-552.054	0	0	0
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	86.221.319	81.440.635	0	-4.780.683	0	0	0
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	93.877.191	109.516.829	0	15.639.638	0	0	0
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	85.333.499	88.075.662	0	2.742.163	0	0	0
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.719.231	73.391.996	0	-327.235	0	0	0
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	65.325.527	68.563.144	0	3.237.617	0	0	0

US4062161017 - HALLIBURTON COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	44.712.341	73.507.831	0	28.795.490	0	0	0
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	69.434.338	73.041.819	0	3.607.481	0	0	0
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	79.951.659	110.291.700	0	30.340.041	0	0	0
US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	81.648.971	76.735.056	0	-4.913.916	0	0	0
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	90.437.599	107.389.941	0	16.952.342	0	0	0
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	86.464.627	113.378.076	0	26.913.449	0	0	0
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	104.577.205	103.235.360	0	-1.341.846	0	0	0
US9182041080 - V.F. CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	40.883.420	36.251.089	0	-4.632.331	0	0	0
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	87.761.370	102.120.543	0	14.359.173	0	0	0
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	88.061.799	92.974.635	0	4.912.836	0	0	0
Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	49.754.774	52.354.793	0	2.600.019	0	0	0
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	49.754.774	52.354.793	0	2.600.019	0	0	0
Акции во затворени инвестициони фондови издадени од странски компании и банки							
Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	12.185.706.572	12.636.973.396	-8.955.439	57.738	-17.705.042	477.869.567	0
MKMINF20G291 - DO2012/05-0817 9.8.2017 0:0:0 - MKD	1.008.463.824	1.068.139.141	0	0	0	59.675.317	0
MKMINF20G499 - DO2013/01-0118 9.1.2018 0:0:0 - MKD	184.735.751	195.111.011	0	0	0	10.375.260	0
MKMINF20G507 - DO2013/03-0118 24.1.2018 0:0:0 - MKD	59.789.176	63.001.139	0	0	0	3.211.963	0
MKMINF20GA71 - DO2014/25-1019 16.10.2019 0:0:0 - MKD	67.844.252	70.576.198	0	0	0	2.731.946	0
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	239.507.752	245.867.670	0	0	0	6.359.918	0
MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	24.013.991	25.178.245	-626.810	16.498	-4.349	1.778.915	0

MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	16.158.433	16.550.175	-197.010	4.234	-13.849	598.366	0
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	34.381.128	35.229.980	-749.902	37.005	-38.324	1.600.073	0
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	96.967.228	99.410.910	-2.768.601	0	-134.730	5.347.013	0
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	58.163	61.173	892	0	-91	2.209	0
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	108.016	111.296	-581	0	-173	4.033	0
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	38.331.938	40.515.550	323.970	0	-61.366	1.921.008	0
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	82.833.359	84.222.281	-2.081.628	0	-131.910	3.602.459	0
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	101.008.501	102.029.038	-2.157.999	0	-150.988	3.329.523	0
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	190.756.680	192.703.153	-697.770	0	-584.010	3.228.253	0
MKMINF20G259 - DO2012/01-0317-DK 26.3.2017 0:0:0 - EUR	197.663.879	208.331.466	0	0	-367.123	11.034.710	0
MKMINF20G267 - DO2012/02-0617-DK 25.6.2017 0:0:0 - EUR	68.079.379	71.808.797	0	0	-126.383	3.855.801	0
MKMINF20G325 - DO2012/07-0817-DK 16.8.2017 0:0:0 - EUR	507.563.216	535.503.311	0	0	-1.036.654	28.976.749	0
MKMINF20G341 - DO2012/09-0917-DK 6.9.2017 0:0:0 - EUR	106.973.160	112.875.157	0	0	-218.420	6.120.417	0
MKMINF20G358 - DO2012/10-0917-DK 20.9.2017 0:0:0 - EUR	144.231.815	152.210.983	0	0	-293.787	8.272.955	0
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017-DK 4.10.2017 0:0:0 - EUR	115.134.193	121.515.600	0	0	-235.151	6.616.558	0
MKMINF20G390 - DO2012/14-1017-DK 18.10.2017 0:0:0 - EUR	114.893.362	121.275.809	0	0	-234.569	6.617.016	0
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117-DK 1.11.2017 0:0:0 - EUR	114.639.010	121.030.588	0	0	-225.580	6.617.157	0
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117-DK 23.11.2017 0:0:0 - EUR	401.813.600	424.283.897	0	0	-821.081	23.291.378	0
MKMINF20G481 - DO2013/02-0118-DK 9.1.2018 0:0:0 - EUR	431.019.113	453.529.692	0	0	-840.580	23.351.159	0
MKMINF20G523 - DO2013/05-0218-DK 28.2.2018 0:0:0 - EUR	59.469.928	62.450.268	0	0	-110.246	3.090.586	0
MKMINF20G549 - DO2013/07-0318-DK 7.3.2018 0:0:0 - EUR	79.152.392	83.125.609	0	0	-146.746	4.119.963	0
MKMINF20G556 - DO2013/08-0318-DK 14.3.2018 0:0:0 - EUR	88.923.979	93.392.379	0	0	-164.870	4.633.270	0

MKMINF20G572 - DO2013/10-0418-DK 4.4.2018 0:0:0 - EUR	78.839.471	82.813.308	0	0	-146.468	4.120.305	0
MKMINF20G580 - DO2013/11-0418-DK 25.4.2018 0:0:0 - EUR	59.011.877	61.844.392	0	0	-109.407	2.941.922	0
MKMINF20G606 - DO2013/13-0518-DK 30.5.2018 0:0:0 - EUR	176.184.962	184.684.562	0	0	-326.693	8.826.292	0
MKMINF20G671 - DO2013/20-0718DK 18.7.2018 0:0:0 - EUR	116.801.495	122.091.223	0	0	-227.485	5.517.214	0
MKMINF20G705 - DO2013/23-0718DK 25.7.2018 0:0:0 - EUR	58.394.793	61.039.885	0	0	-116.721	2.761.813	0
MKMINF20G721 - DO2013/25-0818DK 30.8.2018 0:0:0 - EUR	179.626.108	187.801.147	0	0	-360.602	8.535.641	0
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	231.958.869	242.566.023	0	0	-465.938	11.073.092	0
MKMINF20G762 - DO2013/29-1018DK 17.10.2018 0:0:0 - EUR	57.893.201	60.544.667	0	0	-116.312	2.767.778	0
MKMINF20G770 - DO2013/30-1018DK 31.10.2018 0:0:0 - EUR	77.049.319	80.587.241	0	0	-151.587	3.689.509	0
MKMINF20G788 - DO2013/31-1118DK 21.11.2018 0:0:0 - EUR	134.464.917	140.650.268	0	0	-270.816	6.456.166	0
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	86.268.479	90.243.630	0	0	-173.914	4.149.065	0
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	95.372.225	99.778.902	0	0	-192.334	4.599.012	0
MKMINF20G838 - DO2014/01-0119DK 23.1.2019 0:0:0 - EUR	99.602.385	104.017.290	0	0	-184.450	4.599.355	0
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	44.602.121	46.588.463	0	0	-82.634	2.068.976	0
MKMINF20G903 - DO2014/08-0319DK 27.3.2019 0:0:0 - EUR	29.623.569	30.947.730	0	0	-54.948	1.379.108	0
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	147.457.170	154.082.959	0	0	-273.199	6.898.988	0
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	88.499.704	92.482.387	0	0	-164.031	4.146.714	0
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	293.617.067	306.878.280	0	0	-544.382	13.805.596	0
MKMINF20G960 - DO2014/14-0619DK 19.6.2019 0:0:0 - EUR	58.619.928	61.271.167	0	0	-108.727	2.759.966	0
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	210.507.325	220.721.413	0	0	-423.230	10.637.319	0
MKMINF20GA06 - DO2014/18-0824DK 21.8.2024 0:0:0 - EUR	73.034.758	76.619.448	0	0	-147.633	3.732.323	0
MKMINF20GA14 - DO2014/19-0924DK 4.9.2024 0:0:0 - EUR	48.391.660	50.801.775	0	0	-98.133	2.508.249	0

MKMINF20GA30 - DO2014/21-1017DK 2.10.2017 0:0:0 - EUR	48.820.542	50.340.626	0	0	-95.720	1.615.805	0
MKMINF20GA89 - DO2014/26-1019DK 16.10.2019 0:0:0 - EUR	331.664.071	333.020.212	0	0	-67.669	1.423.810	0
MKMINF20GC79 - DO2015/05-0230DK 12.2.2030 0:0:0 - EUR	129.586.918	134.563.347	0	0	-239.766	5.216.195	0
MKMINF20GD03 - DO2015/08-0230DK 26.2.2030 0:0:0 - EUR	49.766.637	51.680.935	0	0	-92.150	2.006.448	0
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	257.637.660	267.567.634	0	0	-477.039	10.407.013	0
MKMINF20GD52 - DO2015/13-0330DK 26.3.2030 0:0:0 - EUR	59.346.003	61.636.584	0	0	-109.988	2.400.568	0
MKMINF20GD78 - DO2015/15-0430DK 16.4.2030 0:0:0 - EUR	167.964.121	174.458.378	0	0	-315.756	6.810.013	0
MKMINF20GD94 - DO2015/17-0530DK 7.5.2030 0:0:0 - EUR	88.805.710	92.249.819	0	0	-164.263	3.608.372	0
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	177.705.886	183.691.688	0	0	-328.828	6.314.630	0
MKMINF20GE36 - DO2015/21-0625DK 25.6.2025 0:0:0 - EUR	117.789.773	121.770.190	0	0	-218.037	4.198.453	0
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	186.231.189	192.528.763	0	0	-351.661	6.649.235	0
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	185.728.777	192.978.313	0	0	-351.967	7.601.503	0
MKMINF20GE93 - DO2015/27-0725DK 23.7.2025 0:0:0 - EUR	137.059.962	141.690.063	0	0	-268.715	4.898.816	0
MKMINF20GF27 - DO2015/30-0825DK 6.8.2025 0:0:0 - EUR	68.618.895	70.939.278	0	0	-135.097	2.455.480	0
MKMINF20GF76 - DO2015/35-0825DK 27.8.2025 0:0:0 - EUR	117.468.114	121.449.226	0	0	-231.118	4.212.229	0
MKMINF20GG34 - DO2015/41-1030DK 29.10.2030 0:0:0 - EUR	260.767.342	271.066.089	0	0	-508.659	10.807.406	0
MKMINF20GH09 - DO2016/02-0131DK 14.1.2031 0:0:0 - EUR	100.027.000	103.698.080	0	0	-179.876	3.850.956	0
MKMINF20GH17 - DO2016/03-0131DK 22.1.2031 0:0:0 - EUR	150.033.999	155.562.047	0	0	-527.225	6.055.273	0
MKMINF20GH74 - DO2016/07-0231DK 11.2.2031 0:0:0 - EUR	70.018.900	72.429.212	0	0	-247.623	2.657.935	0
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	120.032.399	123.668.077	0	0	-420.477	4.056.155	0
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	150.034.000	154.331.954	0	0	-522.549	4.820.502	0
MKMINF20GI24 - DO2016/12-0431DK 14.4.2031 0:0:0 - EUR	85.022.951	87.366.916	0	0	-247.604	2.591.569	0

MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	80.021.600	81.652.494	0	0	-276.525	1.907.419	0
MKMINF20GI81 - DO2016/18-0826DK 18.8.2026 0:0:0 - EUR	140.034.000	141.900.551	0	0	-25.468	1.892.019	0
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	140.033.999	142.203.857	0	0	-25.535	2.195.393	0
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	140.012.000	141.579.879	0	0	-54.985	1.622.864	0
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	350.012.000	353.712.590	0	0	-71.964	3.772.554	0
MKMINF20GJ64 - DO2016/26-1131DK 3.11.2031 0:0:0 - EUR	270.012.000	271.417.586	0	0	-403.149	1.808.735	0
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	268.452.001	269.374.073	0	0	-7.874	929.946	0
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	716.661.500	717.348.259	0	0	-57.131	743.890	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	227.518.318	224.453.778	-12.207.123	0	8.526.402	616.182	0
FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26 CORP 25.5.2026 0:0:0 - EUR	61.675.917	61.062.740	-591.967	0	-213.928	192.720	0
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 GOV'T 15.5.2026 0:0:0 - USD	165.842.402	163.391.038	-11.615.155	0	8.740.330	423.462	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 компанији и банки							
Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија	312.033.901	318.917.052	0	0	0	6.883.151	0
MKMINFDYG014 - DZ2016/01-364 11.1.2017 0:0:0 - MKD	146.335.750	149.887.935	0	0	0	3.552.185	0
MKMINFDYG022 - DZ2016/02-363 18.1.2017 0:0:0 - MKD	97.472.300	99.873.129	0	0	0	2.400.829	0

МКMINFDYG105 - DZ2016/10-364 21.6.2017 0:0:0 - MKD	68.225.850	69.155.988	0	0	0	930.138	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	2.720.639.591	2.974.378.260	0	253.738.669	0	0	0
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	354.174.998	388.883.649	0	34.708.651	0	0	0
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	124.088.779	126.473.478	0	2.384.699	0	0	0
US4642865251 - EDGE ISHARES MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	244.456.423	265.113.275	0	20.656.851	0	0	0
US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	36.620.081	39.884.799	0	3.264.719	0	0	0
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN CAPPED ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	176.960.622	189.034.068	0	12.073.446	0	0	0

US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	64.736.268	62.807.333	0	-1.928.935	0	0	0
US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	138.770.587	147.033.276	0	8.262.689	0	0	0
US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	57.845.208	61.511.555	0	3.666.347	0	0	0
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	163.454.145	190.214.339	0	26.760.193	0	0	0
US4642874659 - ISHARES MSCI EAFE ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	72.112.089	73.312.923	0	1.200.834	0	0	0
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	136.672.742	173.476.327	0	36.803.585	0	0	0
US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	45.853.528	47.556.758	0	1.703.230	0	0	0
US46434G8226 - BLACK ROCK INC. USA - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	343.551.025	370.758.796	0	27.207.771	0	0	0
US46434G8309 - BLACK ROCK INC. USA - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	36.488.341	33.258.429	0	-3.229.912	0	0	0
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	257.873.012	272.776.284	0	14.903.272	0	0	0
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	466.981.743	532.282.971	0	65.301.228	0	0	0
Други ненаведени хартии од вредност издадени од странски влади и компании							

ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	18.711.382.364	19.671.088.913	-21.162.562	504.678.852	-9.178.640	485.368.900	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	23.701	0	0	0	0	0	23.701
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	6.490.744.687	2.403.497	6.493.148.183
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	9.215.566.428	9.215.566.428
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	64.676.168	681.084.307	1.215.000.000	0	0	4.657.338.353	6.618.098.827
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	44.267.317	0	44.267.317
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	64.699.869	681.084.307	1.215.000.000	0	6.535.012.004	13.875.308.277	22.371.104.457
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	12.304.684	0	12.304.684
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	12.304.684	0	12.304.684
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	64.699.869	681.084.307	1.215.000.000	0	6.522.707.319	13.875.308.277	22.358.799.772

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	3,98	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти расположливи за продавање	4,34	4,82	2,46	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	3,93	4,10	0,01	0,01	0,00
Обврски	%	%	%	%	%
Обврски по основ на заеми и кредити					

Обелоденувања поврзани со ликвидносниот ризик

	Резидуална рочност на достасување на средствата и обврските				
	од 1 до 3 месеци	од 3 до 12 мес.	од 1 до 5 год.	над 5 год.	Вкупно
Средства					
1) Пари и депозити кај банки	23.701	0	0	0	23.701
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	6.493.148.183	0	0	0	6.493.148.183
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	9.215.566.428	0	0	0	9.215.566.428
4) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	250.344.040	1.413.562.048	1.638.000.000	3.316.192.739	6.618.098.827
5) Останати средства на пензискиот фонд	44.267.317	0	0	0	44.267.317
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	16.003.349.669	1.413.562.048	1.638.000.000	3.316.192.739	22.371.104.457
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	12.304.684	0	0	0	12.304.684
8) Вкупно обврски (6+7)	12.304.684	0	0	0	12.304.684
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	15.991.044.985	1.413.562.048	1.638.000.000	3.316.192.739	22.358.799.772
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	15.991.044.985	17.404.607.033	19.042.607.033	22.358.799.772	

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	23.701	0	0	0	0	23.701
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	886.284.063	1.377.024.606	4.041.422.548	0	188.416.966	6.493.148.183
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	1.378.992.377	7.673.183.012	163.391.038	0	0	9.215.566.428
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	2.861.732.353	3.652.313.765	100.709.174	0	3.343.535	6.618.098.827
5) Останати средства на пензискиот фонд	36.450.001	0	7.817.316	-	0	44.267.317
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	5.163.482.495	12.702.521.383	4.313.340.077	0	191.760.501	22.371.104.457
Обврски	9.959.489	0	2.345.195	0	0	12.304.684

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