



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен задолжителен пензиски

фонд НЛБ Пензиски фонд

За првите девет месеци од 2016 година

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 средствта на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд	5
4.	Финансиски показатели според сметководствените единици	7
5.	Извештај за бројот на сметководствени единици	8
6.	Извештај за структура на инвестициите	9
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 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	64.237	71.710
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		2.518	2.155
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ	4	267.852	54.004
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	17.180.874	20.903.402
12	3	Финансиски средства кои се чуват за тргување		5.043.565	6.080.409
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		8.875.918	9.366.937
14	5	Финансиски средства кои се чуват до достасување		3.261.391	5.456.056
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		17.515.482	21.031.271
16	20	Обврски за неконвиртирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		32.726	0
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		26	16
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	15.665	12.072
23	27	Обврски за брокерски и посреднички провизии		11	0
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		568	647
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		48.996	12.735
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		17.466.486	21.018.536
28		Број на издадени сметководствени единици		105.575.389,08 4720	120.468.446,240 802
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		165,440885	174,473373
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови и на фондот		13.904.455	16.472.783
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		50.147	52.031
32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-30.558	-51.108
33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-164.529	-179.606
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		434.723	521.275

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	12.120	5.274
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		17.466.486	21.018.536

2. Извештај за работењето на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд 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 премијат а/дисконтот на хартиите од вредност кои достасуваат на фиксен датум	8	420.198	455.520
2	71	Приходи од дивиденди	9	86.264	103.172
3	73	Реализирани капитални добивки	10	98.917	18.097
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		67.360	52.993
5	75	Други неспоменати приходи	11	1.158	1.274
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		673.895	631.056
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	12	60.355	70.504
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	13	37.910	21.745
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		61.876	49.273
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	14	1.479	850
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		1.421	0
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		163.041	142.372
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		510.854	488.684
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	15	-98.222	51.551
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		22.091	-18.960
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		-76.131	32.591
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		434.723	521.275

3. Извештај за промени на нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд 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 РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
1	Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	510.854	488.684
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	-76.131	32.591
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	-3.008	-7.778
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	431.715	513.497
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	1.722.717	1.951.910
6	91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	2.365	1.647
7	92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-3.605	-13.466
8	93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-8.787	-13.054
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	1.712.690	1.927.037
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	2.144.405	2.440.534
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	15.322.081	18.578.003
12		На крајот на периодот (10+11)	17.466.486	21.018.536
		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	10.309.161,511719	11.456.392,108211
14		Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	14.082,494365	9.711,077094
15		Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-21.688,805136	-79.287,273393
16		Повлечени сметководствени единици врз основа на пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-51.933,398178	-76.479,549763
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	10.249.621,802770	11.310.336,362149

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	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	17.466.486	21.018.536
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	105.575.389,084720	120.468.446,240802
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	165,440885	174,473373
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,003666	0,003614
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,030295	0,024753
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	6,63%	6,21%

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

16.865.525

19.742.074

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 4,44% за 2016, односно 5,07% за 2015 година.

**5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОЗПФ НЛБ
Пензиски фонд 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	109.158.109,878653	14.367.063
2	Издадени сметководствени единици в рз основана уплатени придонеси во текот на периодот	11.456.392,108211	1.951.910
3	Издадени сметководствени единици в рз основана пренос на средства од други пензиски фондови и од промена на членство во текот на периодот	9.711,077094	1.647
4	Повлечени сметководствени единици в рз основана исплата на пензии/пензиски надоместоци	-79.287,273393	-13.466
5	Повлечени сметководствени единици в рз основана пренос на средства во други пензиски фондови и од промена на членство	-76.479,549763	-13.054
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	120.468.446,240802	16.294.100
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		170,193521
	На крајот на периодот		174,473373

6. Извештај за структура на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд 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	46.153	5.445	251.286.054	5.445	251.304.931	3,23%	1,19%
МКФЕРS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	561	37.830	21.222.630	41.116	23.066.076	3,12%	0,11%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	212.968	490	104.354.320	527	112.140.430	6,93%	0,53%
МККМBS101019 - КОМЕРЦИЈАЛНА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.546	2.295	15.025.296	2.450	16.037.700	0,29%	0,08%
МКМТSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	430.268	290	124.668.224	270	116.172.360	0,45%	0,55%
МКМТUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	39.222	3.850	151.004.700	3.491	136.924.002	8,68%	0,65%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.720	2.578	19.902.594	3.280	25.321.600	1,76%	0,12%
МКРРIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.617	28.017	45.302.858	30.500	49.318.856	4,04%	0,23%
МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.667	40.995	68.337.995	42.000	70.014.000	6,41%	0,33%
МКТЕТЕ101016 - ТЕТЕКС АД ТЕТОВО - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.697	645	6.899.565	644	6.888.975	2,58%	0,03%
МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.548	8.987	13.911.707	8.343	12.914.964	2,01%	0,06%
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.010	2.600	15.626.000	2.500	15.025.000	2,23%	0,07%
МКЗРКО101012 - ЗК ПЕЛАГОНИЈА АД БИТОЛА - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.370	1.600	5.392.000	1.745	5.880.650	1,66%	0,03%
Приоритетни акции							
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			842.933.942		841.009.544		4,00%
Обични акции							

BE0003793107 - ANHEUSER-BUSCH INBEV NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	12.880	7.046	90.758.066	7.170	92.352.181	0,00%	0,44%
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	22.041	4.615	101.710.006	4.320	95.211.222	0,00%	0,45%
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	20.159	4.184	84.350.586	4.328	87.252.457	0,00%	0,41%
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	21.950	5.433	119.262.079	4.600	100.978.037	0,00%	0,48%
DE0006048408 - HENKEL AG & CO. KGAA ST - ОБИЧНИ АКЦИИ	12.500	5.459	68.231.529	6.371	79.634.730	0,00%	0,38%
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	12.860	5.536	71.194.653	6.408	82.402.698	0,00%	0,39%
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	12.171	9.414	114.573.303	8.123	98.869.383	0,00%	0,47%
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	20.670	4.224	87.311.897	4.680	96.741.973	0,00%	0,46%
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	23.056	4.707	108.518.345	4.159	95.900.375	0,00%	0,46%
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	82.608	1.424	117.631.436	1.165	96.213.237	0,00%	0,46%
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.799	8.869	95.773.130	9.335	100.806.389	0,00%	0,48%
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	33.010	3.063	101.109.177	2.815	92.909.298	0,00%	0,44%
US02079K3059 - ALPHABET INC -	1.610	43.860	70.614.354	44.065	70.943.971	0,00%	0,34%
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.550	9.028	86.221.319	9.142	87.302.487	0,00%	0,42%
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	16.212	5.791	93.877.191	6.195	100.440.375	0,00%	0,48%
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	5.325	16.025	85.333.499	17.155	91.349.618	0,00%	0,43%
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	24.350	2.422	58.971.907	2.319	56.473.641	0,00%	0,27%
US26875P1012 - EOG RESOURCES INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.400	3.991	41.503.735	5.300	55.119.578	0,00%	0,26%
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	37.200	1.756	65.325.527	1.623	60.385.012	0,00%	0,29%
US4062161017 - HALLIBURTON COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	23.300	1.919	44.712.341	2.460	57.307.298	0,00%	0,27%
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.340	7.434	69.434.338	7.052	65.865.667	0,00%	0,31%
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	24.914	3.648	90.896.944	3.649	90.918.788	0,00%	0,43%
US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.500	4.915	51.606.545	4.853	50.959.842	0,00%	0,24%
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	29.630	3.052	90.437.599	3.157	93.530.940	0,00%	0,44%
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	19.420	5.202	101.031.471	4.937	95.879.768	0,00%	0,46%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	29.380	3.309	97.212.259	2.967	87.170.835	0,00%	0,41%
US9078181081 - UNION PACIFIC CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	12.674	4.408	55.873.051	5.345	67.741.232	0,00%	0,32%
US9182041080 - V.F. CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	11.650	3.509	40.883.420	3.072	35.785.139	0,00%	0,17%
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	30.300	2.680	81.209.347	2.849	86.313.766	0,00%	0,41%

US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	28.925	3.044	88.061.799	2.427	70.191.115	0,00%	0,33%
Приоритетни акции							
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	1.163	42.781	49.754.774	42.598	49.540.908	0,00%	0,24%
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			2.523.385.626		2.492.491.960		11,85%
Вкупно вложувања во акции			3.366.319.569		3.333.501.504		15,85%

(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					
MKMINF20G234 - DO2011/03-1216 19.12.2016 0:0:0 - MKD	735.000.000	736.278.673	767.524.500	58,78%	3,65%
MKMINF20G291 - DO2012/05-0817 9.8.2017 0:0:0 - MKD	1.045.000.000	1.008.463.823	1.053.331.858	88,71%	5,01%
MKMINF20G499 - DO2013/01-0118 9.1.2018 0:0:0 - MKD	185.000.000	184.735.751	192.453.078	100,00%	0,92%
MKMINF20G507 - DO2013/03-0118 24.1.2018 0:0:0 - MKD	60.000.000	59.789.175	62.180.742	100,00%	0,30%
MKMINF20GA71 - DO2014/25-1019 16.10.2019 0:0:0 - MKD	70.000.000	70.574.252	72.625.840	5,81%	0,35%
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	240.000.000	239.507.751	244.256.659	96,00%	1,16%
MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	408.659	24.013.991	24.911.049	22,70%	0,12%
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	271.437	16.158.432	16.471.145	4,52%	0,08%
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	580.435	34.381.129	34.925.317	8,41%	0,17%
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	1.654.445	96.967.228	98.348.998	13,79%	0,47%
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	1.025	58.164	59.293	0,02%	0,00%
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	1.882	108.016	109.578	0,03%	0,00%
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	688.798	38.331.938	40.098.675	7,57%	0,19%
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	1.439.371	82.833.359	82.908.487	17,99%	0,39%
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	1.752.900	101.008.502	100.967.922	20,50%	0,48%
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	3.150.653	180.519.432	181.238.740	26,26%	0,86%
MKMINF20G259 - DO2012/01-0317-DK 26.3.2017 0:0:0 - EUR	3.252.133	197.663.879	205.585.115	79,21%	0,98%
MKMINF20G267 - DO2012/02-0617-DK 25.6.2017 0:0:0 - EUR	1.136.017	68.079.379	70.861.852	6,06%	0,34%
MKMINF20G325 - DO2012/07-0817-DK 16.8.2017 0:0:0 - EUR	8.536.516	507.563.215	528.440.782	56,76%	2,51%
MKMINF20G341 - DO2012/09-0917-DK 6.9.2017 0:0:0 - EUR	1.804.834	106.973.159	111.388.042	30,58%	0,53%
MKMINF20G358 - DO2012/10-0917-DK 20.9.2017 0:0:0 - EUR	2.438.826	144.231.815	150.204.936	14,44%	0,71%
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017-DK 4.10.2017 0:0:0 - EUR	1.950.982	121.732.766	126.509.178	95,24%	0,60%
MKMINF20G390 - DO2012/14-1017-DK 18.10.2017 0:0:0 - EUR	1.951.128	121.492.547	126.259.533	92,66%	0,60%

MKMINF20G408 - DO2012/15-1117-DK 1.11.2017 0:0:0 - EUR	1.951.178	121.246.887	126.004.235	38,19%	0,60%
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117-DK 23.11.2017 0:0:0 - EUR	6.862.391	425.023.448	441.715.385	83,51%	2,10%
MKMINF20G481 - DO2013/02-0118-DK 9.1.2018 0:0:0 - EUR	7.007.560	431.019.112	447.655.576	18,50%	2,13%
MKMINF20G523 - DO2013/05-0218-DK 28.2.2018 0:0:0 - EUR	973.762	59.469.928	61.679.393	11,17%	0,29%
MKMINF20G549 - DO2013/07-0318-DK 7.3.2018 0:0:0 - EUR	1.297.421	79.152.392	82.099.093	100,00%	0,39%
MKMINF20G556 - DO2013/08-0318-DK 14.3.2018 0:0:0 - EUR	1.459.066	88.923.979	92.239.078	84,91%	0,44%
MKMINF20G572 - DO2013/10-0418-DK 4.4.2018 0:0:0 - EUR	1.297.526	78.839.471	81.790.649	31,77%	0,39%
MKMINF20G580 - DO2013/11-0418-DK 25.4.2018 0:0:0 - EUR	973.394	59.011.877	61.117.001	35,29%	0,29%
MKMINF20G606 - DO2013/13-0518-DK 30.5.2018 0:0:0 - EUR	2.920.182	176.184.962	182.512.230	70,18%	0,87%
MKMINF20G671 - DO2013/20-0718DK 18.7.2018 0:0:0 - EUR	1.945.368	116.801.495	120.742.859	44,77%	0,57%
MKMINF20G705 - DO2013/23-0718DK 25.7.2018 0:0:0 - EUR	973.457	58.394.793	60.365.490	34,71%	0,29%
MKMINF20G721 - DO2013/25-0818DK 30.8.2018 0:0:0 - EUR	3.008.345	179.626.107	185.726.042	45,65%	0,88%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	3.901.963	242.996.446	250.918.725	55,22%	1,19%
MKMINF20G762 - DO2013/29-1018DK 17.10.2018 0:0:0 - EUR	975.589	60.652.860	62.629.650	46,86%	0,30%
MKMINF20G770 - DO2013/30-1018DK 31.10.2018 0:0:0 - EUR	1.300.760	80.732.023	83.362.577	53,69%	0,40%
MKMINF20G788 - DO2013/31-1118DK 21.11.2018 0:0:0 - EUR	2.276.116	140.902.782	145.494.076	57,38%	0,69%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	1.462.898	90.406.050	93.351.575	60,65%	0,44%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.621.644	99.958.737	103.215.285	32,11%	0,49%
MKMINF20G838 - DO2014/01-0119DK 23.1.2019 0:0:0 - EUR	1.621.771	99.602.385	102.868.496	25,41%	0,49%
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	729.513	44.602.120	46.073.909	15,74%	0,22%
MKMINF20G903 - DO2014/08-0319DK 27.3.2019 0:0:0 - EUR	486.265	29.623.570	30.605.969	24,27%	0,15%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	2.431.844	147.457.170	152.380.835	68,34%	0,72%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	1.461.929	88.499.704	91.460.948	56,25%	0,43%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	4.863.947	293.617.067	303.486.310	70,96%	1,44%
MKMINF20G960 - DO2014/14-0619DK 19.6.2019 0:0:0 - EUR	972.763	58.619.928	60.594.234	32,17%	0,29%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	3.493.685	210.507.323	218.122.904	83,66%	1,04%
MKMINF20GA06 - DO2014/18-0824DK 21.8.2024 0:0:0 - EUR	1.219.685	73.034.758	75.710.944	12,51%	0,36%
MKMINF20GA14 - DO2014/19-0924DK 4.9.2024 0:0:0 - EUR	813.169	48.391.660	50.192.185	79,37%	0,24%
MKMINF20GA30 - DO2014/21-1017DK 2.10.2017 0:0:0 - EUR	810.985	50.516.147	51.646.296	12,77%	0,25%
MKMINF20GA89 - DO2014/26-1019DK 16.10.2019 0:0:0 - EUR	486.582	30.091.441	30.895.209	3,96%	0,15%
MKMINF20GC79 - DO2015/05-0230DK 12.2.2030 0:0:0 - EUR	2.113.649	129.586.918	133.269.122	61,90%	0,63%
MKMINF20GD03 - DO2015/08-0230DK 26.2.2030 0:0:0 - EUR	813.011	49.766.637	51.183.849	58,82%	0,24%
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	4.215.947	257.637.661	264.993.480	31,74%	1,26%
MKMINF20GD52 - DO2015/13-0330DK 26.3.2030 0:0:0 - EUR	972.578	59.346.003	61.043.702	18,78%	0,29%
MKMINF20GD78 - DO2015/15-0430DK 16.4.2030 0:0:0 - EUR	2.759.037	167.964.121	172.780.256	61,92%	0,82%
MKMINF20GD94 - DO2015/17-0530DK 7.5.2030 0:0:0 - EUR	1.462.088	88.805.710	91.362.652	35,94%	0,43%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	2.924.727	177.705.886	182.146.046	88,80%	0,87%
MKMINF20GE36 - DO2015/21-0625DK 25.6.2025 0:0:0 - EUR	1.945.052	117.789.773	120.745.918	0,00%	0,57%
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	3.079.626	186.231.190	190.908.706	97,94%	0,91%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	3.079.626	185.728.777	191.121.957	30,22%	0,91%
MKMINF20GE93 - DO2015/27-0725DK 23.7.2025 0:0:0 - EUR	2.269.287	137.059.962	140.498.064	3,24%	0,67%
MKMINF20GF27 - DO2015/30-0825DK 6.8.2025 0:0:0 - EUR	1.137.601	68.618.895	70.342.588	100,00%	0,33%
MKMINF20GF76 - DO2015/35-0825DK 27.8.2025 0:0:0 - EUR	1.951.457	117.468.115	120.427.655	88,89%	0,57%
MKMINF20GG34 - DO2015/41-1030DK 29.10.2030 0:0:0 - EUR	4.378.319	271.546.361	279.194.390	90,00%	1,33%

MKMINF20GH09 - DO2016/02-0131DK 14.1.2031 0:0:0 - EUR	1.623.703	100.027.000	102.700.748	5,07%	0,49%
MKMINF20GH17 - DO2016/03-0131DK 22.1.2031 0:0:0 - EUR	2.431.374	150.034.000	153.954.046	63,03%	0,73%
MKMINF20GH74 - DO2016/07-0231DK 11.2.2031 0:0:0 - EUR	1.134.606	70.018.901	71.680.601	11,35%	0,34%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.945.077	120.032.400	122.389.589	96,00%	0,58%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	2.431.382	150.034.000	152.736.313	100,00%	0,73%
MKMINF20GI24 - DO2016/12-0431DK 14.4.2031 0:0:0 - EUR	1.378.565	85.022.950	86.463.711	70,83%	0,41%
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	1.296.737	80.021.600	80.808.365	100,00%	0,38%
MKMINF20GI81 - DO2016/18-0826DK 18.8.2026 0:0:0 - EUR	2.276.712	140.034.000	140.637.981	90,52%	0,67%
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	2.276.712	140.034.000	140.733.660	90,91%	0,67%
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	2.276.230	140.012.000	140.115.645	62,22%	0,67%
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	5.691.640	350.011.999	350.054.057	95,89%	1,66%
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		11.445.911.857	11.800.611.578		56,11%
Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки					
FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26 CORP 25.5.2026 0:0:0 - EUR	1.000.000	61.675.917	63.854.350	0,01%	0,30%
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 GOVT 15.5.2026 0:0:0 - USD	2.000.000	111.129.437	110.529.994	0,00%	0,53%
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		172.805.354	174.384.344		0,83%
Вкупно инвестиции во обврзници		11.618.717.210	11.974.995.922		56,94%

(3) Други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови

ОПИС	Номинална вредност	Трошок на набавка (во ден.)	Вкупна вредност на денот на известување (во денари)	% на издавачот	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4	5	6
Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија					
MKMINFDYF230 - DZ2015/23-364 1.12.2016 0:0:0 - MKD	100.000.000	97.749.722	99.580.907	2,50%	0,47%
MKMINFDYF248 - DZ2015/24-364 14.12.2016 0:0:0 - MKD	200.000.000	195.302.410	198.981.049	86,02%	0,95%
MKMINFDYG014 - DZ2016/01-364 11.1.2017 0:0:0 - MKD	150.000.000	146.335.750	148.953.928	15,38%	0,71%
MKMINFDYG022 - DZ2016/02-363 18.1.2017 0:0:0 - MKD	100.000.000	97.472.300	99.227.185	100,00%	0,47%
MKMINFDYG105 - DZ2016/10-364 21.6.2017 0:0:0 - MKD	70.000.000	68.225.850	68.708.725	17,50%	0,33%
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		605.086.032	615.451.794		2,93%
Удели во отворени инвестициони фондови					
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	57.713	324.678.921	327.076.137	0,06%	1,56%
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	23.860	124.088.779	130.379.802	0,10%	0,62%
US4642865251 - EDGE ISHARES MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	62.600	244.456.423	261.380.672	0,28%	1,24%
US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	27.719	36.620.081	36.700.810	0,22%	0,17%

US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	112.809	176.960.622	179.717.324	1,05%	0,85%
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	40.620	64.736.268	59.703.509	0,09%	0,28%
US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	95.200	138.770.587	137.056.042	0,06%	0,65%
US4642868487 - ISHARES MSCI JAPAN ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	520.400	343.551.025	357.631.684	0,04%	1,70%
US4642868552 - ISHARES INC-MSCI ITALY CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	47.107	36.488.341	28.449.079	0,08%	0,14%
US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	9.000	57.845.208	60.755.258	0,01%	0,29%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	29.680	163.454.145	180.074.373	0,35%	0,86%
US4642874659 - ISHARES MSCI EAFE ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	21.773	72.112.089	70.554.922	0,00%	0,34%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	71.600	136.672.742	153.030.780	0,27%	0,73%
US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	45.000	45.853.528	44.932.652	0,34%	0,21%
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	148.516	257.873.012	264.329.092	0,83%	1,26%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	41.580	436.033.277	452.753.335	0,02%	2,15%
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		2.660.195.048	2.744.525.470		13,05%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		3.265.281.079	3.359.977.264		15,98%

(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	171.948.301	172.065.736	0,82%
Долгорочни депозити	2.049.224.800	2.062.861.301	9,81%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	2.221.173.101	2.234.927.037	10,63%

7. Структура на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд 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	3.333.501.504	15,85%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	11.974.995.922	56,94%
Краткорочни хартии од вредност	615.451.794	2,93%
Акции и удели во инвестициони фондови	2.744.525.470	13,05%
Парични средства	71.710.199	0,34%
Пласмани и депозити	2.234.927.037	10,63%
Останати средства	56.159.622	0,27%
Вкупно средства	21.031.271.548	100,00%

8. Извештај за реализирани добивки и загуби на ОЗПФ НЛБ Пензиски фонд за период 1.1.- 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	50.950	204.808.440	205.027.939	219.499
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
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
20.04.2016	DE000BASF111 - BAS	2.000	8.448.176	8.621.709	173.533
20.04.2016	FR0000120628 - CS	5.000	7.494.785	6.883.486	-611.299
10.03.2016	FR0000121014 - MC	1.500	13.285.595	14.806.859	1.521.264
10.03.2016	FR0000131104 - BNP	3.000	9.306.971	8.792.264	-514.707
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
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
04.08.2016	US5949181045 - MSFT	3.500	10.682.808	10.917.860	235.052
08.06.2016	US9078181081 - UNP	4.000	17.633.912	19.416.642	1.782.730
	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 - РМДЕН06	8.658	0	8.346	8.346
31.05.2016	MKMINF200D76 - РМДЕН07	1.438	0	2.051	2.051
31.05.2016	MKMINF200D84 - РМДЕН08	9.307	0	15.277	15.277

	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	1.500	83.677.868	87.959.119	4.281.252
26.01.2016	US912810RN00 - US TREASURY 30	1.500	83.677.868	87.959.119	4.281.252
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	289.142	431.567.507	423.390.847	-8.176.661
16.03.2016	US4642862100 - HYXU	6.000	15.007.993	15.327.660	319.667
17.03.2016	US4642862100 - HYXU	7.000	17.509.325	18.345.435	836.110
28.03.2016	US4642862100 - HYXU	2.142	5.357.853	5.527.185	169.332
31.03.2016	US4642862100 - HYXU	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				-3.647.872

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.- 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	842.933.942	841.009.544	0	-1.924.398	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИДАД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	251.286.054	251.304.931	0	18.878	0	0	0
	МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	21.222.630	23.066.076	0	1.843.446	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	104.354.320	112.140.430	0	7.786.110	0	0	0
	МККМBS101019 - КОМЕРЦИЈАЛНА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	15.025.296	16.037.700	0	1.012.404	0	0	0
	МКМТСК101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	124.668.224	116.172.360	0	-8.495.864	0	0	0
	МКМТУР101018 - МАКЕДОНИЈА ТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	151.004.700	136.924.002	0	-14.080.698	0	0	0
	МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	19.902.594	25.321.600	0	5.419.006	0	0	0
	МКРРИV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	45.302.858	49.318.856	0	4.015.998	0	0	0
	МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	68.337.995	70.014.000	0	1.676.005	0	0	0
	МКТЕТЕ101016 - ТЕТЕКС АД ТЕТОВО - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.899.565	6.888.975	0	-10.590	0	0	0
	МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.911.707	12.914.964	0	-996.743	0	0	0
	МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	15.626.000	15.025.000	0	-601.000	0	0	0
	МКЗРКО101012 - ЗК ПЕЛАГОНИЈА АД БИТОЛА - ОБИЧНИ АКЦИИ	5.392.000	5.880.650	0	488.650	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	2.473.630.853	2.442.951.053	0	-30.679.800	0	0	0
	BE0003793107 - ANHEUSER-BUSCH INBEV NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	90.758.066	92.352.181	0	1.594.115	0	0	0
	CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	101.710.006	95.211.222	0	-6.498.784	0	0	0
	CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	84.350.586	87.252.457	0	2.901.871	0	0	0
	DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	119.262.079	100.978.037	0	-18.284.043	0	0	0
	DE0006048408 - HENKEL AG & CO. KGAA ST - ОБИЧНИ АКЦИИ	68.231.529	79.634.730	0	11.403.201	0	0	0
	DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	71.194.653	82.402.698	0	11.208.045	0	0	0
	DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	114.573.303	98.869.383	0	-15.703.920	0	0	0
	DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	87.311.897	96.741.973	0	9.430.076	0	0	0
	FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	108.518.345	95.900.375	0	-12.617.970	0	0	0
	FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	117.631.436	96.213.237	0	-21.418.199	0	0	0
	FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	95.773.130	100.806.389	0	5.033.259	0	0	0
	FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	101.109.177	92.909.298	0	-8.199.879	0	0	0
	US02079K3059 - ALPHABET INC -	70.614.354	70.943.971	0	329.618	0	0	0
	US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	86.221.319	87.302.487	0	1.081.169	0	0	0
	US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	93.877.191	100.440.375	0	6.563.184	0	0	0
	US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	85.333.499	91.349.618	0	6.016.120	0	0	0
	US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	58.971.907	56.473.641	0	-2.498.266	0	0	0
	US26875P1012 - EOG RESOURCES INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	41.503.735	55.119.578	0	13.615.843	0	0	0
	US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	65.325.527	60.385.012	0	-4.940.515	0	0	0
	US4062161017 - HALLIBURTON COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	44.712.341	57.307.298	0	12.594.957	0	0	0
	US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	69.434.338	65.865.667	0	-3.568.672	0	0	0
	US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	90.896.944	90.918.788	0	21.845	0	0	0
	US5184391044 - ESTEE LAUDER COMPANIES - ОБИЧНИ АКЦИИ	51.606.545	50.959.842	0	-646.703	0	0	0
	US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	90.437.599	93.530.940	0	3.093.340	0	0	0
	US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	101.031.471	95.879.768	0	-5.151.703	0	0	0

US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	97.212.259	87.170.835	0	-10.041.424	0	0	0
US9078181081 - UNION PACIFIC CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	55.873.051	67.741.232	0	11.868.181	0	0	0
US9182041080 - V.F. CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	40.883.420	35.785.139	0	-5.098.281	0	0	0
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	81.209.347	86.313.766	0	5.104.419	0	0	0
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	88.061.799	70.191.115	0	-17.870.684	0	0	0
Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	49.754.774	49.540.908	0	-213.866	0	0	0
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	49.754.774	49.540.908	0	-213.866	0	0	0
Акции во затворени инвестициони фондови и издадени од странски компании и банки							
Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	11.445.911.857	11.800.611.577	-8.937.839	36.584	-15.282.752	378.883.728	0
MKMINF20G234 - DO2011/03-1216 19.12.2016 0:0:0 - MKD	736.278.673	767.524.500	0	0	0	31.245.827	0
MKMINF20G291 - DO2012/05-0817 9.8.2017 0:0:0 - MKD	1.008.463.823	1.053.331.858	0	0	0	44.868.035	0
MKMINF20G499 - DO2013/01-0118 9.1.2018 0:0:0 - MKD	184.735.751	192.453.078	0	0	0	7.717.327	0
MKMINF20G507 - DO2013/03-0118 24.1.2018 0:0:0 - MKD	59.789.175	62.180.742	0	0	0	2.391.566	0
MKMINF20GA71 - DO2014/25-1019 16.10.2019 0:0:0 - MKD	70.574.252	72.625.840	0	0	0	2.051.588	0
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	239.507.751	244.256.659	0	0	0	4.748.908	0
MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	24.013.991	24.911.049	-577.251	10.837	766	1.462.707	0
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	16.158.432	16.471.145	-149.876	3.397	-10.405	469.597	0
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	34.381.129	34.925.317	-686.590	22.350	-31.396	1.239.824	0
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	96.967.228	98.348.998	-2.630.949	0	-114.467	4.127.186	0
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	58.164	59.293	-490	0	-78	1.697	0
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	108.016	109.578	-1.375	0	-149	3.086	0
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	38.331.938	40.098.675	355.104	0	-53.169	1.464.802	0
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	82.833.359	82.908.487	-2.547.554	0	-114.703	2.737.386	0
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	101.008.502	100.967.922	-2.369.962	0	-129.543	2.458.925	0
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	180.519.432	181.238.740	-328.897	0	-543.940	1.592.145	0
MKMINF20G259 - DO2012/01-0317-DK 26.3.2017 0:0:0 - EUR	197.663.879	205.585.115	0	0	-323.727	8.244.963	0
MKMINF20G267 - DO2012/02-0617-DK 25.6.2017 0:0:0 - EUR	68.079.379	70.861.852	0	0	-111.425	2.893.898	0

MKMINF20G325 - DO2012/07-0817-DK 16.8.2017 0:0:0 - EUR	507.563.215	528.440.782	0	0	-925.108	21.802.674	0
MKMINF20G341 - DO2012/09-0917-DK 6.9.2017 0:0:0 - EUR	106.973.159	111.388.042	0	0	-194.908	4.609.790	0
MKMINF20G358 - DO2012/10-0917-DK 20.9.2017 0:0:0 - EUR	144.231.815	150.204.936	0	0	-262.081	6.235.202	0
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017-DK 4.10.2017 0:0:0 - EUR	121.732.766	126.509.178	0	0	-209.861	4.986.272	0
MKMINF20G390 - DO2012/14-1017-DK 18.10.2017 0:0:0 - EUR	121.492.547	126.259.533	0	0	-209.447	4.976.433	0
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117-DK 1.11.2017 0:0:0 - EUR	121.246.887	126.004.235	0	0	-209.023	4.966.370	0
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117-DK 23.11.2017 0:0:0 - EUR	425.023.448	441.715.385	0	0	-732.751	17.424.688	0
MKMINF20G481 - DO2013/02-0118-DK 9.1.2018 0:0:0 - EUR	431.019.112	447.655.576	0	0	-746.110	17.382.574	0
MKMINF20G523 - DO2013/05-0218-DK 28.2.2018 0:0:0 - EUR	59.469.928	61.679.393	0	0	-97.238	2.306.703	0
MKMINF20G549 - DO2013/07-0318-DK 7.3.2018 0:0:0 - EUR	79.152.392	82.099.093	0	0	-129.431	3.076.132	0
MKMINF20G556 - DO2013/08-0318-DK 14.3.2018 0:0:0 - EUR	88.923.979	92.239.078	0	0	-145.417	3.460.516	0
MKMINF20G572 - DO2013/10-0418-DK 4.4.2018 0:0:0 - EUR	78.839.471	81.790.649	0	0	-129.218	3.080.396	0
MKMINF20G580 - DO2013/11-0418-DK 25.4.2018 0:0:0 - EUR	59.011.877	61.117.001	0	0	-96.526	2.201.650	0
MKMINF20G606 - DO2013/13-0518-DK 30.5.2018 0:0:0 - EUR	176.184.962	182.512.230	0	0	-288.224	6.615.492	0
MKMINF20G671 - DO2013/20-0718DK 18.7.2018 0:0:0 - EUR	116.801.495	120.742.859	0	0	-202.055	4.143.420	0
MKMINF20G705 - DO2013/23-0718DK 25.7.2018 0:0:0 - EUR	58.394.793	60.365.490	0	0	-104.007	2.074.704	0
MKMINF20G721 - DO2013/25-0818DK 30.8.2018 0:0:0 - EUR	179.626.107	185.726.042	0	0	-321.486	6.421.420	0
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	242.996.446	250.918.725	0	0	-415.415	8.337.694	0
MKMINF20G762 - DO2013/29-1018DK 17.10.2018 0:0:0 - EUR	60.652.860	62.629.650	0	0	-103.688	2.080.478	0
MKMINF20G770 - DO2013/30-1018DK 31.10.2018 0:0:0 - EUR	80.732.023	83.362.577	0	0	-138.012	2.768.566	0
MKMINF20G788 - DO2013/31-1118DK 21.11.2018 0:0:0 - EUR	140.902.782	145.494.076	0	0	-240.875	4.832.169	0
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	90.406.050	93.351.575	0	0	-154.550	3.100.075	0
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	99.958.737	103.215.285	0	0	-170.880	3.427.427	0
MKMINF20G838 - DO2014/01-0119DK 23.1.2019 0:0:0 - EUR	99.602.385	102.868.496	0	0	-162.784	3.428.895	0
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	44.602.120	46.073.909	0	0	-72.930	1.544.718	0
MKMINF20G903 - DO2014/08-0319DK 27.3.2019 0:0:0 - EUR	29.623.570	30.605.969	0	0	-48.502	1.030.901	0
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	147.457.170	152.380.835	0	0	-241.106	5.164.772	0
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	88.499.704	91.460.948	0	0	-144.769	3.106.013	0
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	293.617.067	303.486.310	0	0	-480.464	10.349.708	0

MKMINF20G960 - DO2014/14-0619DK 19.6.2019 0:0:0 - EUR	58.619.928	60.594.234	0	0	-95.965	2.070.270	0
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	210.507.323	218.122.904	0	0	-377.256	7.992.836	0
MKMINF20GA06 - DO2014/18-0824DK 21.8.2024 0:0:0 - EUR	73.034.758	75.710.944	0	0	-131.673	2.807.859	0
MKMINF20GA14 - DO2014/19-0924DK 4.9.2024 0:0:0 - EUR	48.391.660	50.192.185	0	0	-87.551	1.888.076	0
MKMINF20GA30 - DO2014/21-1017DK 2.10.2017 0:0:0 - EUR	50.516.147	51.646.296	0	0	-85.236	1.215.386	0
MKMINF20GA89 - DO2014/26-1019DK 16.10.2019 0:0:0 - EUR	30.091.441	30.895.209	0	0	-51.058	854.825	0
MKMINF20GC79 - DO2015/05-0230DK 12.2.2030 0:0:0 - EUR	129.586.918	133.269.122	0	0	-211.740	3.893.945	0
MKMINF20GD03 - DO2015/08-0230DK 26.2.2030 0:0:0 - EUR	49.766.637	51.183.849	0	0	-81.387	1.498.598	0
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	257.637.661	264.993.480	0	0	-421.312	7.777.131	0
MKMINF20GD52 - DO2015/13-0330DK 26.3.2030 0:0:0 - EUR	59.346.003	61.043.702	0	0	-97.150	1.794.850	0
MKMINF20GD78 - DO2015/15-0430DK 16.4.2030 0:0:0 - EUR	167.964.121	172.780.256	0	0	-279.421	5.095.556	0
MKMINF20GD94 - DO2015/17-0530DK 7.5.2030 0:0:0 - EUR	88.805.710	91.362.652	0	0	-145.049	2.701.991	0
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	177.705.886	182.146.046	0	0	-290.571	4.730.732	0
MKMINF20GE36 - DO2015/21-0625DK 25.6.2025 0:0:0 - EUR	117.789.773	120.745.918	0	0	-192.676	3.148.822	0
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	186.231.190	190.908.706	0	0	-311.564	4.989.081	0
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	185.728.777	191.121.957	0	0	-311.775	5.704.954	0
MKMINF20GE93 - DO2015/27-0725DK 23.7.2025 0:0:0 - EUR	137.059.962	140.498.064	0	0	-239.206	3.677.308	0
MKMINF20GF27 - DO2015/30-0825DK 6.8.2025 0:0:0 - EUR	68.618.895	70.342.588	0	0	-120.323	1.844.016	0
MKMINF20GF76 - DO2015/35-0825DK 27.8.2025 0:0:0 - EUR	117.468.115	120.427.655	0	0	-205.824	3.165.364	0
MKMINF20GG34 - DO2015/41-1030DK 29.10.2030 0:0:0 - EUR	271.546.361	279.194.390	0	0	-461.604	8.109.633	0
MKMINF20GH09 - DO2016/02-0131DK 14.1.2031 0:0:0 - EUR	100.027.000	102.700.748	0	0	-158.278	2.832.026	0
MKMINF20GH17 - DO2016/03-0131DK 22.1.2031 0:0:0 - EUR	150.034.000	153.954.046	0	0	-494.825	4.414.871	0
MKMINF20GH74 - DO2016/07-0231DK 11.2.2031 0:0:0 - EUR	70.018.901	71.680.601	0	0	-232.537	1.894.237	0
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	120.032.400	122.389.589	0	0	-394.719	2.751.909	0
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	150.034.000	152.736.313	0	0	-490.404	3.192.718	0
MKMINF20GI24 - DO2016/12-0431DK 14.4.2031 0:0:0 - EUR	85.022.950	86.463.711	0	0	-229.407	1.670.167	0
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	80.021.600	80.808.365	0	0	-259.519	1.046.284	0
MKMINF20GI81 - DO2016/18-0826DK 18.8.2026 0:0:0 - EUR	140.034.000	140.637.981	0	0	4.085	599.896	0
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	140.034.000	140.733.660	0	0	4.083	695.577	0

	MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	140.012.000	140.115.645	0	0	-25.496	129.141	0
	MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	350.011.999	350.054.057	0	0	1.708	40.350	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	172.805.354	174.384.344	1.796.598	0	-554.984	337.377	0
	FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26 CORP 25.5.2026 0:0:0 - EUR	61.675.917	63.854.350	2.264.555	0	-201.092	114.971	0
	US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 GOVT 15.5.2026 0:0:0 - USD	111.129.437	110.529.994	-467.957	0	-353.893	222.406	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	605.086.032	615.451.795	0	0	0	10.365.763	0
	MKMINFDYF230 - DZ2015/23-364 1.12.2016 0:0:0 - MKD	97.749.722	99.580.907	0	0	0	1.831.186	0
	MKMINFDYF248 - DZ2015/24-364 14.12.2016 0:0:0 - MKD	195.302.410	198.981.049	0	0	0	3.678.639	0
	MKMINFDYG014 - DZ2016/01-364 11.1.2017 0:0:0 - MKD	146.335.750	148.953.928	0	0	0	2.618.178	0
	MKMINFDYG022 - DZ2016/02-363 18.1.2017 0:0:0 - MKD	97.472.300	99.227.185	0	0	0	1.754.885	0
	MKMINFDYG105 - DZ2016/10-364 21.6.2017 0:0:0 - MKD	68.225.850	68.708.725	0	0	0	482.875	0
	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	2.660.195.048	2.744.525.470	0	84.330.423	0	0	0
	DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	324.678.921	327.076.137	0	2.397.216	0	0	0
	US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	124.088.779	130.379.802	0	6.291.024	0	0	0
	US4642865251 - EDGE ISHARES MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	244.456.423	261.380.672	0	16.924.248	0	0	0
	US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	36.620.081	36.700.810	0	80.729	0	0	0
	US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	176.960.622	179.717.324	0	2.756.703	0	0	0
	US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	64.736.268	59.703.509	0	-5.032.759	0	0	0
	US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	138.770.587	137.056.042	0	-1.714.545	0	0	0
	US4642868487 - ISHARES MSCI JAPAN ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	343.551.025	357.631.684	0	14.080.659	0	0	0
	US4642868552 - ISHARES INC-MSCI ITALY CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	36.488.341	28.449.079	0	-8.039.262	0	0	0
	US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	57.845.208	60.755.258	0	2.910.050	0	0	0
	US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	163.454.145	180.074.373	0	16.620.227	0	0	0
	US4642874659 - ISHARES MSCI EAFE ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	72.112.089	70.554.922	0	-1.557.167	0	0	0
	US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	136.672.742	153.030.780	0	16.358.038	0	0	0
	US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	45.853.528	44.932.652	0	-920.876	0	0	0
	US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	257.873.012	264.329.092	0	6.456.080	0	0	0
	US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	436.033.277	452.753.335	0	16.720.058	0	0	0

	Други ненаведени хартии од вредност издадени од странски влади и компании							
	ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	18.250.317.858	18.668.474.691	-7.141.241	51.548.942	-15.837.736	389.586.868	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	71.710.199	0	0	0	0	0	71.710.199
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	6.078.026.974	2.382.343	6.080.409.317
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	9.366.936.698	9.366.936.698
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	58.361.861	392.325.692	1.349.394.886	0	0	3.655.973.273	5.456.055.712
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	56.159.622	0	56.159.622
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	130.072.060	392.325.692	1.349.394.886	0	6.134.186.596	13.025.292.314	21.031.271.548
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	12.735.394	0	12.735.394
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	12.735.394	0	12.735.394
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	130.072.060	392.325.692	1.349.394.886	0	6.121.451.202	13.025.292.314	21.018.536.154

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	3,92	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти расположливи за продавање	5,19	4,92	1,60	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	4,08	4,13	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	71.710.199	0	0	0	71.710.199
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	6.080.409.317	0	0	0	6.080.409.317
3) Финансиски инструменти расположлив и за продавање	9.366.936.698	0	0	0	9.366.936.698
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	58.800.025	978.274.666	1.772.394.886	2.646.586.135	5.456.055.712
5) Останати средства на пензискиот фонд	56.159.622	0	0	0	56.159.622
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	15.634.015.861	978.274.666	1.772.394.886	2.646.586.135	21.031.271.548
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	12.735.394	0	0	0	12.735.394
8) Вкупно обврски (6+7)	12.735.394	0	0	0	12.735.394
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	15.621.280.467	978.274.666	1.772.394.886	2.646.586.135	21.018.536.155
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	15.621.280.467	16.599.555.133	18.371.950.019	21.018.536.154	

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	71.549.310	0	160.889	0	0	71.710.199
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	841.009.544	1.266.266.781	3.790.669.313	0	182.463.679	6.080.409.317
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	2.433.281.937	6.823.124.767	110.529.994	0	0	9.366.936.698
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	2.483.109.423	2.886.009.859	83.634.408	0	3.302.022	5.456.055.712
5) Останати средства на пензискиот фонд	54.004.216	0	2.155.406	-	0	56.159.622
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	5.882.954.429	10.975.401.407	3.987.150.011	0	185.765.700	21.031.271.548
Обврски	12.088.772	0	646.622	0	0	12.735.394

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