



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен доброволен пензиски фонд НЛБ Пензија Плус

За период од 01.01. до 31.12.2017 година



NLB

Нов пензиски фонд

Содржина

1. Извештај за нето средствата на ОДПФ НЛБ Пензија Плус на ден 31.12.2017	3
2. Извештај за работењето на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01.-31.12.2017	5
3. Извештај за промените на нето средствата на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01.-31.12.2017	6
4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01.-31.12.2017	8
5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01-31.12.2017	9
6. Извештај за структурата на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус на ден 31.12.2017	10
7. Структура на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус по видови на финансиски средства на ден 31.12.2017	20
8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 31.12.2017	21
9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОДПФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 31.12.2017	23

1. Извештај за нето средствата на ОДФП НЛБ Пензија Плус на ден 31.12.2017

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	31.12.2016 (во 000 ден.)	31.12.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
1	10	Парични средства	3	4.685	5.794
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		188	184
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ		0	0
5	14	Побарувања од други пензиски фондови		0	410
6	15	Побарувања за дадени аванси		0	0
7	16	Побарувања од пензиските друштва или чуварот на имот		0	0
8	17	Побарувања од државата и други институции		0	0
9	18	Побарувања за хартии од вредност купени директно од издавачот		0	0
10	19	Платени трошоци за идните периоди и недостасана наплата на приходи (АВР)		0	0
11		Вложувања во хартии од вредност и депозити (12+13+14)	4	456.178	597.251
12	3	Финансиски средства кои се чуваат за тргување		183.314	240.387
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		174.283	209.163
14	5	Финансиски средства кои се чуваат до достасување		98.581	147.701
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		461.051	603.639
16	20	Обврски за неконвертирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		1.228	0
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		0	642
19	23	Обврски за пренос на средства на други пензиски фондови по основ на промена на членство		137	0
20	24	Краткорочни обврски за заеми и кредити		0	0
21	25	Долгорочни обврски за заеми и кредити		0	0
22	26	Обврски кон пензиското друштво	5	553	713
23	27	Обврски за брокерски и		0	0

		посреднички провизии			
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		58	51
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		1.976	1.406
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		459.075	602.233
28		Број на издадени сметководствени единици		2.969.860,269841	3.668.683,902176
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		154,578083	164,155073
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		412.053	539.755
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		1.052	2.363
32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-21.477	-35.491
33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-549	-2.276
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		21.390	29.272
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		47.348	68.737
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	6	-742	-127
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		459.075	602.233

2. Извештај за работењето на ОДФП НЛБ Пензија Плус за периодот 01.01.-31.12.2017

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	31.12.2016 (во 000 ден.)	31.12.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
		ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА			
1	70	Приходи од камати и Амортизација на премијата/дисконтот на хартиите од вредност кои достасуваат на фиксен датум	7	8.470	11.424
2	71	Приходи од дивиденди	8	3.842	4.733
3	73	Реализирани капитални добивки	9	887	1.412
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		1.276	691
5	75	Други неспоменати приходи		0	0
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		14.475	18.260
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	10	4.545	6.241
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	11	256	336
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		1.046	859
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	12	51	78
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		1	0
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		5.899	7.514
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		8.576	10.746
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	13	13.045	19.691
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		-231	-1.165
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		12.814	18.526
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		21.390	29.272

**3. Извештај за промените на нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија
Плус за периодот 01.01.-31.12.2017**

Ознака на позиција	Група на сметки	ПОЗИЦИЈА	31.12.2016 (во 000 ден.)	31.12.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5
		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВА ЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
1	Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	8.576	10.746
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	12.814	18.526
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	-1.492	615
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВА ЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	19.898	29.887
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	107.790	127.702
6	91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	1.051	1.310
7	92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-7.676	-14.014
8	93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-140	-1.727
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВА ЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	101.025	113.271
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВА ЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	120.923	143.158
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	338.153	459.075
12		На крајот на периодот (10+11)	459.075	602.233
		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	723.644,660900	788.985,613708

14		Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	7.210,614626	8.087,567275
15		Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-52.099,579732	-87.492,770037
16		Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-903,827246	-10.756,778611
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	677.851,868548	698.823,632335

4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01.-31.12.2017

Ознака на позиција	ПОЗИЦИЈА	31.12.2016 (во 000 ден.)	31.12.2017 (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	338.153	459.075
2	Број на сметководствени единици на почетокот на периодот	2.292.008,401293	2.969.860,269841
3	Вредност на сметководствената единица на почетокот на периодот (1/2)	147,535595	154,578083
	Вредноста на нето средствата на пензискиот фонд по сметководствена единица на крајот на периодот		
4	Нето средства на пензискиот фонд на крајот на периодот	459.075	602.233
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	2.969.860,269841	3.668.683,902176
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	154,578083	164,155073
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,011925	0,011985
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,022252	0,020382
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	5,96%	6,22%

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

385.410

527.238

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 2017 и 2016 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 4,72% за 2017, односно 4,36% за 2016 година.

**5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОДФФ НЛБ
Пензија Плус за периодот 01.01-31.12.2017**

реден број	ПОЗИЦИЈА	Број на сметководствен и единици	Извори на средствата на фондот
1	2	3	4
1	На почетокот на периодот	2.969.860,269841	391.079
2	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	788.985,613708	127.702
3	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство во текот на периодот	8.087,567275	1.310
4	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-87.492,770037	-14.014
5	Повлечени сметководствени единици врз основа на пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-10.756,778611	-1.727
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	3.668.683,902176	504.350
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		154,578083
	На крајот на периодот		164,155073

6. Извештај за структурата на инвестициите на ОДФ НЛБ Пензија Плус на ден 31.12.2017

(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	1.232	5.387	6.636.956	7.497	9.236.058	0,09%	1,53%
МКФЕРS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	16	42.000	672.000	55.290	884.640	0,09%	0,15%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.657	583	8.537.868	772	11.312.273	0,48%	1,87%
МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	29.604	260	7.706.857	275	8.141.100	0,03%	1,35%
МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.641	3.699	9.768.436	4.099	10.826.146	0,58%	1,79%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.046	4.217	8.628.800	4.800	9.820.800	0,47%	1,63%
МКРРИV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	322	35.042	11.283.500	38.000	12.236.000	0,81%	2,03%
МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	180	43.111	7.759.993	54.800	9.864.000	0,69%	1,63%
МКВИТА101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	501	8.755	4.386.255	7.062	3.538.062	0,65%	0,59%

МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.346	2.300	3.095.800	2.716	3.655.736	0,50%	0,61%
Приоритетни акции							
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			68.476.466		79.514.814		13,17%
Обични акции							
BE0974293251 - ANHEUSER- BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	388	6.026	2.338.178	5.727	2.221.932	0,00%	0,37%
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	644	4.242	2.732.012	4.330	2.788.449	0,00%	0,46%
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	417	4.182	1.743.953	4.403	1.836.241	0,00%	0,30%
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	611	5.456	3.333.895	5.339	3.262.274	0,00%	0,54%
DE0007164600 - SAP SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	325	5.614	1.824.413	5.746	1.867.549	0,00%	0,31%
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	412	7.188	2.961.365	7.142	2.942.564	0,00%	0,49%
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	258	9.773	2.521.398	11.775	3.038.071	0,00%	0,50%
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	435	5.429	2.361.791	5.641	2.453.903	0,00%	0,41%
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	349	4.636	1.618.103	4.418	1.541.919	0,00%	0,26%
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.101	1.473	3.094.803	1.521	3.195.563	0,00%	0,53%
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	220	11.153	2.453.592	15.090	3.319.760	0,00%	0,55%

FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	830	3.714	3.082.286	3.828	3.177.071	0,00%	0,53%
GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.807	1.501	2.711.565	1.709	3.087.294	0,00%	0,51%
NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	629	4.448	2.798.036	5.104	3.210.245	0,00%	0,53%
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	40	46.614	1.864.550	54.010	2.160.405	0,00%	0,36%
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	41	48.334	1.981.675	59.961	2.458.413	0,00%	0,41%
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	230	8.528	1.961.398	8.916	2.050.734	0,00%	0,34%
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	393	6.755	2.654.831	8.677	3.409.980	0,00%	0,56%
US09062X1037 - BIOGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	141	16.540	2.332.144	16.334	2.303.064	0,00%	0,38%
US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	318	6.103	1.940.608	6.419	2.041.168	0,00%	0,34%
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	690	2.418	1.668.549	2.352	1.623.134	0,00%	0,27%
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.075	1.692	1.819.118	895	961.802	0,00%	0,16%
US4370761029 - THE HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	196	7.820	1.532.783	9.718	1.904.654	0,00%	0,32%
US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	325	7.406	2.406.850	7.863	2.555.509	0,00%	0,42%
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	642	4.959	3.183.432	5.483	3.520.118	0,00%	0,58%
US5184391044 - THE ESTEE LAUDER COMPANIES INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	345	4.461	1.539.162	6.524	2.250.737	0,00%	0,37%
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	630	3.624	2.283.350	4.386	2.763.069	0,00%	0,46%

US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	395	6.755	2.668.124	7.398	2.922.236	0,00%	0,48%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	661	3.238	2.140.482	2.945	1.946.356	0,00%	0,32%
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	820	3.113	2.553.014	2.714	2.225.347	0,00%	0,37%
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	898	3.098	2.781.724	3.111	2.793.395	0,00%	0,46%
Приоритетни акции							
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	21	45.017	945.357	53.651	1.126.676	0,00%	0,19%
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			73.832.541		78.959.631		13,08%
Вкупно вложувања во акции			142.309.007		158.474.445		26,25%

(2) Обврзници					
ОПИС	Номинална вредност	Трошок на набавка (во ден.)	Вкупна вредност на денот на известување (во ден.)	% на издавачот	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4	5	6
Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија					
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	10.000.000	9.980.055	10.243.794	4,00%	1,70%
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	10.753	621.349	666.403	0,36%	0,11%
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	31.881	1.860.863	1.942.390	0,69%	0,32%

MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	239.821	13.887.084	14.182.345	2,66%	2,35%
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	38.842	2.240.772	2.356.718	0,88%	0,39%
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	61.527	3.522.951	3.679.775	1,23%	0,61%
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	42.122	2.410.352	2.516.852	0,54%	0,42%
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	234.880	13.338.346	14.034.558	3,36%	2,33%
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	386.768	21.831.940	22.850.984	5,09%	3,79%
MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	236.036	13.319.182	13.973.030	2,19%	2,31%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	65.033	3.859.118	4.043.276	0,92%	0,67%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	48.763	2.869.777	3.008.361	2,02%	0,50%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	19.460	1.142.314	1.197.436	0,39%	0,20%
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	64.846	3.957.750	4.141.536	1,40%	0,69%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	97.274	5.887.861	6.163.955	2,73%	1,02%
MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	102.137	6.680.682	6.934.660	6,67%	1,15%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	64.975	3.925.984	4.110.677	2,50%	0,68%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	81.066	4.885.046	5.115.472	1,18%	0,85%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	97.498	5.825.594	6.126.115	2,33%	1,01%
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	64.861	3.957.483	4.117.482	0,49%	0,68%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	81.242	4.927.790	5.103.515	2,47%	0,85%

MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	64.834	3.913.861	4.054.048	2,06%	0,67%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	64.834	3.903.381	4.063.580	0,64%	0,67%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	24.313	1.481.545	1.546.033	1,17%	0,26%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	24.314	1.478.880	1.543.563	0,93%	0,26%
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	162.092	9.776.570	10.207.761	5,24%	1,69%
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	48.787	2.918.303	3.047.663	1,95%	0,50%
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	56.906	3.389.425	3.540.549	1,17%	0,59%
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	65.047	3.871.406	4.043.836	0,85%	0,67%
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	58.227	3.438.939	3.593.683	0,77%	0,60%
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	129.460	7.627.456	7.970.711	0,91%	1,32%
MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	48.459	2.980.805	3.098.564	0,43%	0,51%
MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	24.545	1.510.408	1.562.823	0,26%	0,26%
MKMINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	23.883	1.470.397	1.517.439	0,21%	0,25%
MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	32.523	2.000.540	2.061.955	0,34%	0,34%
MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	32.456	2.000.540	2.054.745	0,44%	0,34%
MKMINF20GL11 - DO2017/12-0432DK 6.4.2032 0:0:0 - EUR	113.459	7.001.890	7.172.796	3,08%	1,19%
MKMINF20GL52 - DO2017/16-0632DK 8.6.2032 0:0:0 - EUR	205.041	12.653.416	12.879.431	4,22%	2,13%
MKMINF20GL60 - DO2017/17-0632DK 22.6.2032 0:0:0 - EUR	198.557	12.253.308	12.454.371	3,55%	2,06%

МКМИНФ20GL78 - DO2017/18-0632DK 29.6.2032 0:0:0 - EUR	127.888	7.892.130	8.015.942	0,88%	1,33%
МКМИНФ20GL86 - DO2017/19-0732DK 6.7.2032 0:0:0 - EUR	48.628	3.000.810	3.045.799	0,65%	0,50%
МКМИНФ20GL94 - DO2017/20-0732DK 20.7.2032 0:0:0 - EUR	48.741	3.000.810	3.048.552	2,59%	0,51%
МКМИНФ20GN01 - DO2017/30-1032DK 5.10.2032 0:0:0 - EUR	178.935	11.002.970	11.103.924	0,98%	1,84%
МКМИНФ20GN50 - DO2017/35-1132DK 2.11.2032 0:0:0 - EUR	40.664	2.500.675	2.516.255	0,47%	0,42%
МКМИНФ20GN68 - DO2017/36-1132DK 23.11.2032 0:0:0 - EUR	48.788	3.000.810	3.012.503	0,37%	0,50%
МКМИНФ20GN76 - DO2017/37-1132DK 30.11.2032 0:0:0 - EUR	35.092	2.160.583	2.165.224	1,73%	0,36%
МКМИНФ20GN84 - DO2017/38-1232DK 7.12.2032 0:0:0 - EUR	64.833	4.001.080	3.997.480	1,32%	0,66%
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		251.163.230	259.828.564		43,04%
Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки					
US912810RU43 - T 2 7/8 11/15/46 15.11.2046 0:0:0 - USD	80.000	4.376.450	4.223.792	0,00%	0,70%
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	82.000	4.409.732	3.969.940	0,00%	0,66%
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		8.786.182	8.193.732		1,36%
Вкупно инвестиции во обврзници		259.949.412	268.022.296		44,40%

(3) Други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови					
ОПИС	Номинална вредност	Трошок на набавка (во ден.)	Вкупна вредност на денот на известување (во денари)	% на издавачот	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4	5	6
Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија					
Благајнички записи издадени од Народна Банка на Република Македонија					
Сертификати за депозит и комерцијални записи издадени или гарантирани од банки					
Хартии од вредност врз основа на хипотека издадени од банки					
Комерцијални записи издадени од акционерски друштва, освен банки					
Удели во отворени инвестициони фондови					
Други ненаведени хартии од вредност					
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во инвестициони фондови во Република Македонија		0	0		0,00%

Удели во отворени инвестициони фондови					
DE0002635307 - ISHARES STOXX EUROPE 600 UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.640	6.282.298	6.210.954	0,00%	1,03%
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.249	7.817.144	8.614.867	0,00%	1,43%
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	820	4.838.333	5.237.322	0,01%	0,87%
US4642865095 - ISHARES MSCI CANADA ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.890	4.275.094	4.391.956	0,00%	0,73%
US4642865251 - ISHARES EDGE MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.730	7.326.613	7.479.260	0,00%	1,24%
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.820	4.765.250	4.901.520	0,02%	0,81%
US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	970	1.498.133	1.642.218	0,00%	0,27%
US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	200	1.366.923	1.246.530	0,00%	0,21%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	567	3.693.978	4.467.102	0,01%	0,74%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.610	3.721.169	3.273.038	0,01%	0,54%

US46429B6065 - ISHARES MSCI POLAND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	555	586.533	770.875	0,00%	0,13%
US46434G8226 - ISHARES MSCI JAPAN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.796	10.876.407	11.664.132	0,00%	1,93%
US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.650	2.102.463	1.966.084	0,00%	0,33%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.594	19.236.177	20.047.033	0,00%	3,32%
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		78.386.515	81.912.891		13,57%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		78.386.515	81.912.891		13,57%

(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	8.596.625	8.608.154	1,43%
Долгорочни депозити	79.800.000	80.233.244	13,29%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	88.396.625	88.841.398	14,72%

7. Структура на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија Плус по видови на финансиски средства на ден 31.12.2017

ОПИС	Вкупна вредност на денот на известувањето (во денари)	Процентуален удел во вредноста на пензискиот фонд
Акции	158.474.445	26,25%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	268.022.296	44,40%
Краткорочни хартии од вредност	0	0,00%
Акции и удели во инвестициони фондови	81.912.891	13,57%
Парични средства	5.793.692	0,96%
Пласмани и депозити	88.841.398	14,72%
Останати средства	594.236	0,10%
Вкупно средства	603.638.958	100,00%

8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОДФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 31.12.2017

Датум на продажба	Продадена хартија од вредност	Бр. на хартии од вредност	Сметководствена вредност	Продажна цена	Реализирана добивка или загуба
1	2	3	4	5	6 (5-4)
	Обични акции издадени во Република Македонија	300	1.616.142	1.709.650	93.508
21.3.2017	MKALKA101011 - ALK	90	484.843	512.550	27.707
21.3.2017	MKALKA101011 - ALK	100	538.714	570.100	31.386
23.3.2017	MKALKA101011 - ALK	110	592.585	627.000	34.415
	Обични акции издадени од странски компании и банки	1.450	6.460.828	6.495.498	34.670
16.3.2017	BE0974293251 - ABI	100	618.193	632.038	13.844
16.3.2017	CH0038863350 - NESN	100	418.214	440.863	22.649
18.1.2017	DE0008404005 - ALV	30	289.576	292.873	3.296
18.1.2017	DE000BASF111 - BAS	50	271.470	273.040	1.570
16.3.2017	FR0000120578 - SAN	200	945.581	1.016.857	71.276
18.1.2017	FR0000121014 - MC	50	557.634	574.215	16.581
20.1.2017	FR0000131104 - BNP	80	297.815	295.968	-1.847
24.2.2017	US0378331005 - AAPL	40	270.212	316.520	46.308
12.9.2017	US09075E1001 - BIVV	70	180.028	203.855	23.827
14.11.2017	US4062161017 - HAL	150	473.226	348.692	-124.534
5.12.2017	US4062161017 - HAL	150	473.226	343.663	-129.564
16.3.2017	US5184391044 - EL	110	490.747	543.338	52.590
8.11.2017	US5949181045 - MSFT	60	217.462	268.023	50.561
20.1.2017	US6934751057 - PNC	40	272.871	268.543	-4.328
24.2.2017	US9182041080 - VFC	220	684.570	677.011	-7.559
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	73.500	4.335.700	4.441.604	105.904
29.3.2017	MKMINF200DF7 - RMDEN15	73.500	4.335.700	4.441.604	105.904

	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	40.000	2.475.482	2.409.382	-66.100
7.4.2017	FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26	40.000	2.475.482	2.409.382	-66.100
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	6.781	13.270.292	14.178.101	907.809
17.1.2017	US4642867075 - EWQ	220	316.557	321.807	5.250
18.1.2017	US4642867075 - EWQ	220	316.557	316.699	141
13.10.2017	US4642867646 - EWP	300	463.865	519.025	55.160
18.10.2017	US4642867646 - EWP	300	463.865	517.637	53.772
17.1.2017	US4642868065 - EWG	520	803.123	820.242	17.119
18.1.2017	US4642868065 - EWG	520	803.123	813.056	9.933
7.11.2017	US4642872919 - IXN	65	423.472	536.563	113.091
19.4.2017	US46429B6065 - EPOL	555	586.533	710.567	124.034
22.6.2017	US46434G8309 - EWI UP	535	755.456	814.584	59.128
16.3.2017	US78463X8487 - CWI	3.366	6.182.263	6.646.554	464.291
17.1.2017	US9229083632 - VOO	90	1.077.738	1.085.838	8.099
18.1.2017	US9229083632 - VOO	90	1.077.738	1.075.528	-2.210
	ВКУПНО РЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ				1.075.791

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

9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОДФ НЛБ Пензија Плус за периодот од 01.01.2017 до 31.12.2017

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	68.476.466	79.514.814	0	11.038.348	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.636.956	9.236.058	0	2.599.101	0	0	0
	МКФЕРС101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	672.000	884.640	0	212.640	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.537.868	11.312.273	0	2.774.405	0	0	0
	МКMТSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.706.857	8.141.100	0	434.243	0	0	0
	МКMТUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.768.436	10.826.146	0	1.057.709	0	0	0
	МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.628.800	9.820.800	0	1.192.000	0	0	0
	МКRPIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	11.283.500	12.236.000	0	952.500	0	0	0
	МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.759.993	9.864.000	0	2.104.007	0	0	0
	МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	4.386.255	3.538.062	0	-848.193	0	0	0

МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.095.800	3.655.736	0	559.936	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	72.887.184	77.832.955	0	4.945.772	0	0	0
BE0974293251 - ANHEUSER- BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.338.178	2.221.932	0	-116.246	0	0	0
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.732.012	2.788.449	0	56.437	0	0	0
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.743.953	1.836.241	0	92.288	0	0	0
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.333.895	3.262.274	0	-71.621	0	0	0
DE0007164600 - SAP SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.824.413	1.867.549	0	43.136	0	0	0
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.961.365	2.942.564	0	-18.801	0	0	0
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.521.398	3.038.071	0	516.673	0	0	0
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.361.791	2.453.903	0	92.112	0	0	0
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.618.103	1.541.919	0	-76.184	0	0	0
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.094.803	3.195.563	0	100.760	0	0	0
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.453.592	3.319.760	0	866.168	0	0	0
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.082.286	3.177.071	0	94.785	0	0	0

GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.711.565	3.087.294	0	375.729	0	0	0
NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.798.036	3.210.245	0	412.208	0	0	0
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.864.550	2.160.405	0	295.856	0	0	0
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.981.675	2.458.413	0	476.738	0	0	0
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.961.398	2.050.734	0	89.337	0	0	0
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.654.831	3.409.980	0	755.150	0	0	0
US09062X1037 - BIOGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.332.144	2.303.064	0	-29.081	0	0	0
US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.940.608	2.041.168	0	100.559	0	0	0
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.668.549	1.623.134	0	-45.415	0	0	0
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.819.118	961.802	0	-857.316	0	0	0
US4370761029 - THE HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.532.783	1.904.654	0	371.870	0	0	0
US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.406.850	2.555.509	0	148.659	0	0	0
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.183.432	3.520.118	0	336.685	0	0	0
US5184391044 - THE ESTEE LAUDER COMPANIES INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.539.162	2.250.737	0	711.574	0	0	0
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.283.350	2.763.069	0	479.719	0	0	0
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.668.124	2.922.236	0	254.112	0	0	0

US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.140.482	1.946.356	0	-194.126	0	0	0
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.553.014	2.225.347	0	-327.667	0	0	0
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.781.724	2.793.395	0	11.671	0	0	0
Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	945.357	1.126.676	0	181.318	0	0	0
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	945.357	1.126.676	0	181.318	0	0	0
Акции во затворени инвестициони фондови издадени од странски компании и банки							
Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	251.163.230	259.828.564	236.204	0	-82.409	8.511.539	0
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	9.980.055	10.243.794	0	0	0	263.739	0
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	621.349	666.403	8.746	0	2.441	33.867	0
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	1.860.863	1.942.390	-12.383	0	3.761	90.149	0
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	13.887.084	14.182.345	-371.380	0	19.711	646.929	0
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	2.240.772	2.356.718	10.000	0	2.444	103.501	0
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	3.522.951	3.679.775	19.280	0	2.661	134.884	0
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	2.410.352	2.516.852	9.599	0	805	96.095	0
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	13.338.346	14.034.558	215.101	0	7.600	473.512	0
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	21.831.940	22.850.984	211.605	0	12.613	794.826	0

MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	13.319.182	13.973.030	145.637	0	15.417	492.794	0
MKMINF20G754 - DO2013/28- 1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	3.859.118	4.043.276	0	0	306	183.853	0
MKMINF20G804 - DO2013/33- 1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	2.869.777	3.008.361	0	0	726	137.858	0
MKMINF20G820 - DO2013/35- 1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.142.314	1.197.436	0	0	107	55.015	0
MKMINF20G887 - DO2014/06- 0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	3.957.750	4.141.536	0	0	459	183.327	0
MKMINF20G911 - DO2014/09- 0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	5.887.861	6.163.955	0	0	1.090	275.004	0
MKMINF20G929 - DO2014/10- 0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	6.680.682	6.934.660	0	0	1.320	252.657	0
MKMINF20G937 - DO2014/11- 0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	3.925.984	4.110.677	0	0	1.001	183.692	0
MKMINF20G945 - DO2014/12- 0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	4.885.046	5.115.472	0	0	1.241	229.186	0
MKMINF20G994 - DO2014/17- 0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	5.825.594	6.126.115	0	0	746	299.775	0
MKMINF20GD29 - DO2015/10- 0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	3.957.483	4.117.482	0	0	429	159.570	0
MKMINF20GE02 - DO2015/18- 0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	4.927.790	5.103.515	0	0	915	174.810	0
MKMINF20GE69 - DO2015/24- 0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	3.913.861	4.054.048	0	0	681	139.507	0
MKMINF20GE77 - DO2015/25- 0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	3.903.381	4.063.580	0	0	690	159.510	0
MKMINF20GH82 - DO2016/08- 0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.481.545	1.546.033	0	0	171	64.317	0
MKMINF20GI08 - DO2016/10- 0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	1.478.880	1.543.563	0	0	365	64.318	0
MKMINF20GI32 - DO2016/13- 0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	9.776.570	10.207.761	0	0	2.398	428.793	0
MKMINF20GI99 - DO2016/19- 0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	2.918.303	3.047.663	0	0	301	129.060	0

MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	3.389.425	3.540.549	0	0	586	150.539	0
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	3.871.406	4.043.836	0	0	354	172.077	0
MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	3.438.939	3.593.683	0	0	709	154.035	0
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	7.627.456	7.970.711	0	0	780	342.475	0
MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	2.980.805	3.098.564	0	0	-379	118.137	0
MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	1.510.408	1.562.823	0	0	-808	53.224	0
MKMINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	1.470.397	1.517.439	0	0	-1.483	48.525	0
MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	2.000.540	2.061.955	0	0	-229	61.645	0
MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	2.000.540	2.054.745	0	0	-4.372	58.577	0
MKMINF20GL11 - DO2017/12-0432DK 6.4.2032 0:0:0 - EUR	7.001.890	7.172.796	0	0	-23.582	194.487	0
MKMINF20GL52 - DO2017/16-0632DK 8.6.2032 0:0:0 - EUR	12.653.416	12.879.431	0	0	-42.213	268.229	0
MKMINF20GL60 - DO2017/17-0632DK 22.6.2032 0:0:0 - EUR	12.253.308	12.454.371	0	0	-40.822	241.885	0
MKMINF20GL78 - DO2017/18-0632DK 29.6.2032 0:0:0 - EUR	7.892.130	8.015.942	0	0	-26.235	150.048	0
MKMINF20GL86 - DO2017/19-0732DK 6.7.2032 0:0:0 - EUR	3.000.810	3.045.799	0	0	-9.881	54.871	0
MKMINF20GL94 - DO2017/20-0732DK 20.7.2032 0:0:0 - EUR	3.000.810	3.048.552	0	0	-2.894	50.636	0
MKMINF20GN01 - DO2017/30-1032DK 5.10.2032 0:0:0 - EUR	11.002.970	11.103.924	0	0	2.766	98.188	0
MKMINF20GN50 - DO2017/35-1132DK 2.11.2032 0:0:0 - EUR	2.500.675	2.516.255	0	0	465	15.115	0
MKMINF20GN68 - DO2017/36-1132DK 23.11.2032 0:0:0 - EUR	3.000.810	3.012.503	0	0	21	11.672	0

МКMINF20GN76 - DO2017/37-1132DK 30.11.2032 0:0:0 - EUR	2.160.583	2.165.224	0	0	-2.205	6.846	0
МКMINF20GN84 - DO2017/38-1232DK 7.12.2032 0:0:0 - EUR	4.001.080	3.997.480	0	0	-13.384	9.783	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	8.786.182	8.193.732	344.291	0	-1.061.304	124.563	0
US912810RU43 - T 2 7/8 11/15/46 15.11.2046 0:0:0 - USD	4.376.450	4.223.792	266.698	0	-492.825	73.469	0
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	4.409.732	3.969.940	77.594	0	-568.479	51.094	0
Обврзници и други должнички хартии од вредност издадени од странски единици на локална самоуправа							
Обврзници и други должнички хартии од вредност издадени од странски компании и банки							
Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија							
Благајнички записи издадени од Народна Банка на Република Македонија							
Сертификати за депозит и комерцијални записи издадени или гарантирани од домашни банки							

	Хартии од вредност врз основа на хипотека издадени од домашни банки							
	Комерцијални записи издадени од домашни акционерски друштва, освен банки							
	Удели во домашни отворени инвестициони фондови							
	Други ненаведени домашни хартии од вредност							
	Трезорски записи издадени од странски влади							
	Благајнички записи издадени странски централни банки							
	Комерцијални записи издадени од странски компании и банки							
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	78.386.515	81.912.891	0	3.526.376	0	0	0
	DE0002635307 - ISHARES STOXX EUROPE 600 UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	6.282.298	6.210.954	0	-71.344	0	0	0
	DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	7.817.144	8.614.867	0	797.723	0	0	0
	US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	4.838.333	5.237.322	0	398.989	0	0	0
	US4642865095 - ISHARES MSCI CANADA ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	4.275.094	4.391.956	0	116.863	0	0	0
	US4642865251 - ISHARES EDGE MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	7.326.613	7.479.260	0	152.648	0	0	0

US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	4.765.250	4.901.520	0	136.270	0	0	0
US4642868065 - ISHARES MSCI GERMANY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.498.133	1.642.218	0	144.085	0	0	0
US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.366.923	1.246.530	0	-120.394	0	0	0
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.693.978	4.467.102	0	773.124	0	0	0
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.721.169	3.273.038	0	-448.131	0	0	0
US46429B6065 - ISHARES MSCI POLAND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	586.533	770.875	0	184.342	0	0	0
US46434G8226 - ISHARES MSCI JAPAN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	10.876.407	11.664.132	0	787.725	0	0	0
US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.102.463	1.966.084	0	-136.380	0	0	0
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	19.236.177	20.047.033	0	810.856	0	0	0
Други ненаведени хартии од вредност издадени од странски влади и компании							
ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	480.644.933	508.409.632	580.495	19.691.814	-1.143.713	8.636.102	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	5.793.692	0	0	0	0	0	5.793.692
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	240.387.336	0	240.387.336
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	209.163.303	209.163.303
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	34.973	10.689.923	33.000.000	0	0	103.975.495	147.700.391
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	594.236	0	594.236
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	5.828.665	10.689.923	33.000.000	0	240.981.572	313.138.798	603.638.958
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	1.405.885	0	1.405.885
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	1.405.885	0	1.405.885
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	5.828.665	10.689.923	33.000.000	0	239.575.687	313.138.798	602.233.073

Обелоденување на ефективните каматни стапки за главните валути на средствата и обврските на пензискиот фонд

	МКД	EUR	USD	CHF	UK Pound
Средства	%	%	%	%	%
Пари и депозити кај банки	0,50	0,00	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти расположливи за продавање	2,64	3,96	2,59	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	3,22	4,11	0,00	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	5.793.692	0	0	0	5.793.692
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	240.387.336	0	0	0	240.387.336
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	209.163.303	0	0	0	209.163.303
4) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	457.752	21.952.802	67.400.000	57.889.837	147.700.391
5) Останати средства на пензискиот фонд	594.236	0	0	0	594.236
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	456.396.319	21.952.802	67.400.000	57.889.837	603.638.958
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	1.398.785	7.100	0	0	1.405.885
8) Вкупно обврски (6+7)	1.398.785	7.100	0	0	1.405.885
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	454.997.534	21.945.702	67.400.000	57.889.837	602.233.073
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	454.997.534	476.943.236	544.343.236	602.233.073	

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	5.793.692	0	0	0	0	5.793.692
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	79.514.814	48.143.967	108.103.866	0	4.624.689	240.387.336
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	10.243.794	190.725.778	8.193.731	0	0	209.163.303
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	88.344.748	58.858.994	0	0	496.649	147.700.391
5) Останати средства на пензискиот фонд	470.628	0	123.608	0	0	594.236
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	184.367.676	297.728.739	116.421.205	0	5.121.338	603.638.958
Обврски	1.361.703	0	44.182	0	0	1.405.885

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