



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен
задолжителен пензиски фонд
НЛБ Пензиски фонд

За период од 01.01 до 31.12.2017 година



NLB
Нов пензиски фонд

Содржина

1. Извештај за нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пезиски фонд на ден 31.12.2017	3
2. Извештај за работењето на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот 01.01.-31.12.2017	5
3. Извештај за промените на нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд 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 ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот 01.01-31.12.2017	9
6. Извештаи за структурата на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд на ден 31.12.2017	11
7. Структура на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд по видови на финансиски средства на ден 31.12.2017	25
8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот од 01.01.2017 до 31.12.2017	26
9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОЗПФ Пензиски Фонд за периодот од 01.01.2017 до 31.12.2017	28

1. Извештај за нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пезиски фонд на ден 31.12.2017

реден број	Група на сметки или сметка	П О З И Ц И Ј А	Белешки	31.12.2016 (во 000 ден.)	31.12.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
1	10	Парични средства	3	24	963
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	0
3	12	Побарувања по основ на вложувања		8.293	9.588
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ	4	35.974	33.561
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	22.326.813	26.487.885
12	3	Финансиски средства кои се чуваат за тргување		6.493.148	7.822.882
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		9.215.566	9.996.180
14	5	Финансиски средства кои се чуваат до достасување		6.618.099	8.668.823
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		22.371.104	26.531.997
16	20	Обврски за неконвертирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		0	0
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		4	24
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		0	0

		кредити			
22	26	Обврски кон пензиското друштво	6	9.955	10.186
23	27	Обврски за брокерски и посреднички провизии		0	0
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		2.345	2.752
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		12.304	12.962
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		22.358.800	26.519.035
28		Број на издадени сметководствени единици		124.373.763,124997	139.804.668,693018
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		179,771032	189,686331
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		17.171.880	20.084.807
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		53.638	59.678
32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-58.656	-78.315
33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-182.217	-218.895
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		1.185.015	1.282.577
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		4.197.887	5.382.903
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	7	-8.747	6.280
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		22.358.800	26.519.035

2. Извештај за работењето на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот 01.01.-31.12.2017

реден број	Група на сметки или сметка	П О З И Ц И Ј А	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	8	619.734	701.421
2	71	Приходи од дивиденди	9	125.011	143.390
3	73	Реализирани капитални добивки	10	59.577	50.953
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		61.627	36.581
5	75	Други неспоменати приходи	11	1.374	2.358
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		867.323	934.703
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	12	96.511	102.940
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	13	23.345	22.337
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		55.688	39.446
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	14	989	1.073
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		0	0
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		176.533	165.796
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		690.790	768.907
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	15	504.681	578.903
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		-10.456	-65.233
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		494.225	513.670
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		1.185.015	1.282.577

3. Извештај за промените на нето средствата на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд за периодот 01.01.-31.12.2017

Ознака на позиција	Група на сметки	П О З И Ц И Ј А	31.12.2016 (во 000 ден.)	31.12.2017 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5
		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВ АЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
1	Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	690.790	768.907
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	494.225	513.670
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	-21.800	15.027
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВ АЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	1.163.215	1.297.604
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	2.651.007	2.912.928
6	91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	3.254	6.040
7	92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-21.014	-19.660
8	93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-15.665	-36.678
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВ АЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	2.617.582	2.862.630
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВ АЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	3.780.797	4.160.234
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	18.578.003	22.358.800
12		На крајот на периодот (10+11)	22.358.800	26.519.035

		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	15.410.033,687276	15.701.642,140595
14		Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	18.750,770702	32.559,965482
15		Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-121.931,188873	-106.197,277069
16		Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-91.200,022761	-197.099,260987
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	15.215.653,246344	15.430.905,568021

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

Ознака на позиција	П О З И Ц И Ј А	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	18.578.003	22.358.800
2	Број на сметководствени единици на почетокот на периодот	109.158.109,87 8653	124.373.763,12 4997
3	Вредност на сметководствената единица на почетокот на периодот (1/2)	170,193521	179,771032
	Вредноста на нето средствата на пензискиот фонд по сметководствена единица на крајот на периодот		
4	Нето средства на пензискиот фонд на крајот на периодот	22.358.800	26.519.035
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	124.373.763,12 4997	139.804.668,69 3018
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	179,771032	189,686331
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,004809	0,004219
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,034072	0,031189
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	6,34%	6,13%

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

20.274.637

24.652.882

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 4,63% за 2017, односно 4,74% за 2016 година.

**5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОЗПФ НЛБ
Пензиски Фонд за периодот 01.01-31.12.2017**

реден број	П О З И Ц И Ј А	Број на сметководствени единици	Извори на средствата на фондот
1	2	3	4
1	На почетокот на периодот	124.373.763,124997	16.984.645
2	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	15.701.642,140595	2.912.928
3	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство во текот на периодот	32.559,965482	6.040
4	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-106.197,277069	-19.660
5	Повлечени сметководствени единици врз основа на пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-197.099,260987	-36.678
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	139.804.668,693018	19.847.275
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		179,771032
	На крајот на периодот		189,686331

6. Извештаи за структурата на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд 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	45.030	5.387	242.590.450	7.497	337.580.904	3,15%	1,27%
МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	561	42.000	23.562.000	55.290	31.017.690	3,12%	0,12%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	213.068	580	123.596.440	772	164.445.882	6,94%	0,62%
МККМBS101019 - КОМЕРЦИЈАЛНА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.546	2.854	18.685.361	2.758	18.054.850	0,29%	0,07%
МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	458.044	260	119.154.040	275	125.962.100	0,48%	0,47%
МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	39.222	3.699	145.072.373	4.099	160.781.176	8,68%	0,61%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.620	3.989	42.358.640	4.800	50.976.000	2,42%	0,19%
МКRPIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.101	35.185	73.924.000	38.000	79.838.000	5,25%	0,30%
МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.849	43.061	79.619.810	54.800	101.325.200	7,11%	0,38%
МКТЕТЕ101016 - ТЕТЕКС АД ТЕТОВО - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.697	935	10.001.695	1.947	20.831.231	2,58%	0,08%

МКВІТА101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.843	8.784	16.189.585	7.062	13.015.266	2,39%	0,05%
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.010	2.300	13.823.000	2.716	16.323.160	2,23%	0,06%
МКЗРКО101012 - ЗК ПЕЛАГОНИЈА АД БИТОЛА - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.370	2.500	8.425.000	2.600	8.762.000	1,66%	0,03%
Приоритетни акции							
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			917.002.393		1.128.913.459		4,25%
Обични акции							
BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.780	6.078	83.752.693	5.727	78.912.946	0,00%	0,30%
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	24.541	4.242	104.109.171	4.330	106.259.813	0,00%	0,40%
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.159	4.182	55.032.803	4.403	57.945.069	0,00%	0,22%
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	18.950	5.456	103.399.851	5.339	101.178.550	0,00%	0,38%
DE0006048408 - HENKEL AG & CO. KGAA ST - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.700	6.085	46.857.651	6.149	47.347.839	0,00%	0,18%
DE0007164600 - SAP SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.500	5.681	48.288.966	5.746	48.843.600	0,00%	0,18%
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	15.988	7.151	114.335.210	7.142	114.188.611	0,00%	0,43%
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.471	9.758	102.172.752	11.775	123.300.936	0,00%	0,46%
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	18.170	5.429	98.652.285	5.641	102.499.819	0,00%	0,39%
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ	12.856	4.670	60.037.664	4.418	56.799.181	0,00%	0,21%

АКЦИИ							
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	85.608	1.473	126.116.516	1.521	130.207.411	0,00%	0,49%
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.199	11.153	91.440.903	15.090	123.721.416	0,00%	0,47%
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	32.310	3.721	120.220.381	3.828	123.676.091	0,00%	0,47%
GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	47.976	1.506	72.270.731	1.709	81.967.912	0,00%	0,31%
NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	20.300	4.425	89.821.638	5.104	103.605.680	0,00%	0,39%
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.610	46.220	74.414.651	54.010	86.956.318	0,00%	0,33%
US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.800	48.296	86.932.676	59.961	107.930.340	0,00%	0,41%
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.550	8.528	81.440.635	8.916	85.150.050	0,00%	0,32%
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.212	6.755	89.250.946	8.677	114.637.808	0,00%	0,43%
US09062X1037 - BIOGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	5.325	16.540	88.075.662	16.334	86.977.404	0,00%	0,33%
US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.100	6.108	61.690.619	6.419	64.829.544	0,00%	0,24%
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	30.350	2.418	73.391.996	2.352	71.394.385	0,00%	0,27%
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	57.000	1.727	98.419.976	895	50.997.894	0,00%	0,19%
US4370761029 - THE HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.340	7.820	73.041.819	9.718	90.762.571	0,00%	0,34%
US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.648	7.319	107.209.180	7.863	115.178.756	0,00%	0,43%
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	25.114	4.991	125.341.259	5.483	137.701.294	0,00%	0,52%

US5184391044 - THE ESTEE LAUDER COMPANIES INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.200	4.461	58.889.694	6.524	86.115.146	0,01%	0,32%
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	26.220	3.624	95.030.856	4.386	114.996.305	0,00%	0,43%
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	17.620	6.776	119.400.877	7.398	130.353.918	0,00%	0,49%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	36.880	3.184	117.426.723	2.945	108.595.463	0,00%	0,41%
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	32.800	3.113	102.120.543	2.714	89.013.872	0,00%	0,34%
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	33.925	3.132	106.263.595	3.111	105.529.967	0,00%	0,40%
Приоритетни акции							
US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	1.163	45.017	52.354.793	53.651	62.396.381	0,00%	0,24%
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			2.927.205.716		3.109.972.292		11,72%
Вкупно вложувања во акции			3.844.208.109		4.238.885.750		15,98%

(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					
MKMINF20G499 - DO2013/01-0118 9.1.2018 0:0:0 - MKD	185.000.000	184.751.011	195.098.041	100,00%	0,74%
MKMINF20G507 - DO2013/03-0118 24.1.2018 0:0:0 - MKD	60.000.000	59.791.139	62.994.231	100,00%	0,24%
MKMINF20GA71 - DO2014/25-1019 16.10.2019 0:0:0 - MKD	70.000.000	67.846.198	70.570.552	5,81%	0,27%
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	240.000.000	239.507.669	245.850.017	96,00%	0,93%
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	136.824	7.911.062	8.479.268	4,56%	0,03%
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	386.957	22.597.922	23.575.942	8,41%	0,09%
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	1.305.885	75.740.188	77.226.377	14,51%	0,29%
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	820	47.261	49.753	0,02%	0,00%
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	2.012	115.812	120.327	0,04%	0,00%
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	590.398	33.594.873	35.277.540	7,57%	0,13%
MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	1.259.450	71.345.992	75.254.771	17,99%	0,28%
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	1.618.765	91.362.441	95.639.675	21,30%	0,36%

MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	3.049.682	171.338.301	180.537.172	28,24%	0,68%
MKMINF20G481 - DO2013/02-0118-DK 9.1.2018 0:0:0 - EUR	7.007.560	430.259.626	453.580.295	18,50%	1,71%
MKMINF20G523 - DO2013/05-0218-DK 28.2.2018 0:0:0 - EUR	973.762	59.365.203	62.453.131	11,17%	0,24%
MKMINF20G549 - DO2013/07-0318-DK 7.3.2018 0:0:0 - EUR	1.297.421	79.016.601	83.131.057	100,00%	0,31%
MKMINF20G556 - DO2013/08-0318-DK 14.3.2018 0:0:0 - EUR	1.459.066	88.771.558	93.398.499	84,91%	0,35%
MKMINF20G572 - DO2013/10-0418-DK 4.4.2018 0:0:0 - EUR	1.297.526	78.690.756	82.818.736	31,77%	0,31%
MKMINF20G580 - DO2013/11-0418-DK 25.4.2018 0:0:0 - EUR	973.394	58.909.877	61.849.712	35,29%	0,23%
MKMINF20G606 - DO2013/13-0518-DK 30.5.2018 0:0:0 - EUR	2.920.182	175.863.646	184.700.982	70,18%	0,70%
MKMINF20G671 - DO2013/20-0718DK 18.7.2018 0:0:0 - EUR	1.945.368	116.583.564	122.099.787	44,77%	0,46%
MKMINF20G705 - DO2013/23-0718DK 25.7.2018 0:0:0 - EUR	973.457	58.284.891	61.045.230	34,71%	0,23%
MKMINF20G721 - DO2013/25-0818DK 30.8.2018 0:0:0 - EUR	3.008.345	179.272.105	187.818.341	45,65%	0,71%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	3.901.963	231.533.112	242.590.421	55,22%	0,91%
MKMINF20G762 - DO2013/29-1018DK 17.10.2018 0:0:0 - EUR	975.589	57.785.654	60.549.969	46,86%	0,23%
MKMINF20G770 - DO2013/30-1018DK 31.10.2018 0:0:0 - EUR	1.300.760	76.908.336	80.593.492	53,69%	0,30%
MKMINF20G788 - DO2013/31-1118DK 21.11.2018 0:0:0 - EUR	2.276.116	134.212.446	140.661.359	57,38%	0,53%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	1.462.898	86.092.264	90.250.329	60,65%	0,34%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.621.644	95.192.232	99.786.042	32,11%	0,38%
MKMINF20G838 - DO2014/01-0119DK 23.1.2019 0:0:0 - EUR	1.621.771	99.429.600	104.025.113	25,41%	0,39%

MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	729.513	44.524.228	46.592.033	15,74%	0,18%
MKMINF20G903 - DO2014/08-0319DK 27.3.2019 0:0:0 - EUR	486.265	29.567.891	30.949.933	24,27%	0,12%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	2.431.844	147.191.583	154.095.975	68,34%	0,58%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	1.461.929	88.333.382	92.489.482	56,25%	0,35%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	4.863.947	293.074.543	306.911.341	70,96%	1,16%
MKMINF20G960 - DO2014/14-0619DK 19.6.2019 0:0:0 - EUR	972.763	58.510.491	61.276.649	32,17%	0,23%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	3.493.685	209.972.477	220.598.503	83,66%	0,83%
MKMINF20GA06 - DO2014/18-0824DK 21.8.2024 0:0:0 - EUR	1.219.685	72.869.320	76.595.563	12,51%	0,29%
MKMINF20GA14 - DO2014/19-0924DK 4.9.2024 0:0:0 - EUR	813.169	48.293.505	50.806.563	79,37%	0,19%
MKMINF20GA89 - DO2014/26-1019DK 16.10.2019 0:0:0 - EUR	5.352.407	320.843.501	332.569.036	43,54%	1,25%
MKMINF20GC79 - DO2015/05-0230DK 12.2.2030 0:0:0 - EUR	2.113.649	129.353.151	134.578.666	44,29%	0,51%
MKMINF20GD03 - DO2015/08-0230DK 26.2.2030 0:0:0 - EUR	813.011	49.680.499	51.686.870	58,82%	0,19%
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	4.215.947	257.197.416	267.599.676	31,74%	1,01%
MKMINF20GD52 - DO2015/13-0330DK 26.3.2030 0:0:0 - EUR	972.578	59.236.747	61.643.729	18,78%	0,23%
MKMINF20GD78 - DO2015/15-0430DK 16.4.2030 0:0:0 - EUR	2.759.037	167.671.621	174.478.625	61,92%	0,66%
MKMINF20GD94 - DO2015/17-0530DK 7.5.2030 0:0:0 - EUR	1.462.088	88.642.491	92.260.075	35,94%	0,35%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	2.924.727	177.384.072	183.711.886	88,80%	0,69%
MKMINF20GE36 - DO2015/21-0625DK 25.6.2025 0:0:0 - EUR	1.945.052	117.570.183	121.782.536	100,00%	0,46%

MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	3.079.626	185.889.240	192.550.106	97,94%	0,73%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	3.079.626	185.390.287	193.000.928	30,22%	0,73%
MKMINF20GE93 - DO2015/27-0725DK 23.7.2025 0:0:0 - EUR	2.269.287	136.802.763	141.704.949	93,33%	0,53%
MKMINF20GF27 - DO2015/30-0825DK 6.8.2025 0:0:0 - EUR	1.137.601	68.490.803	70.946.418	82,35%	0,27%
MKMINF20GF76 - DO2015/35-0825DK 27.8.2025 0:0:0 - EUR	1.951.457	117.243.018	121.461.540	87,62%	0,46%
MKMINF20GG34 - DO2015/41-1030DK 29.10.2030 0:0:0 - EUR	4.378.319	260.297.473	271.098.621	69,30%	1,02%
MKMINF20GH09 - DO2016/02-0131DK 14.1.2031 0:0:0 - EUR	1.623.703	99.704.140	103.709.937	51,81%	0,39%
MKMINF20GH17 - DO2016/03-0131DK 22.1.2031 0:0:0 - EUR	2.431.374	149.132.696	155.579.927	40,49%	0,59%
MKMINF20GH74 - DO2016/07-0231DK 11.2.2031 0:0:0 - EUR	1.134.606	69.422.618	72.437.383	76,42%	0,27%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.945.077	118.523.617	123.682.603	93,53%	0,47%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	2.431.382	147.881.807	154.350.408	92,88%	0,58%
MKMINF20GI24 - DO2016/12-0431DK 14.4.2031 0:0:0 - EUR	1.378.565	83.720.588	87.377.178	68,55%	0,33%
MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	1.296.737	78.212.561	81.662.085	41,88%	0,31%
MKMINF20GI81 - DO2016/18-0826DK 18.8.2026 0:0:0 - EUR	2.276.712	136.720.458	141.916.701	90,52%	0,53%
MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	2.276.712	136.183.750	142.220.749	90,91%	0,54%
MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	2.276.230	135.551.521	141.597.782	46,90%	0,53%
MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	5.691.640	338.666.505	353.758.204	74,39%	1,33%
MKMINF20GJ64 - DO2016/26-1131DK 3.11.2031 0:0:0 - EUR	4.385.032	259.824.631	271.452.453	50,68%	1,02%

MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	4.366.085	257.802.483	269.408.675	57,73%	1,02%
MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	11.655.480	686.528.801	717.441.410	82,37%	2,70%
MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	7.074.710	444.506.016	456.087.499	62,15%	1,72%
MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	3.246.885	199.761.501	206.697.281	34,74%	0,78%
MKMINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	7.147.360	439.931.500	454.014.346	62,84%	1,71%
MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	2.439.223	150.011.500	154.618.821	25,48%	0,58%
MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	2.434.168	150.011.500	154.078.030	32,86%	0,58%
MKMINF20GL11 - DO2017/12-0432DK 6.4.2032 0:0:0 - EUR	3.079.611	190.011.501	194.651.960	83,70%	0,73%
MKMINF20GL37 - DO2017/14-0532DK 4.5.2032 0:0:0 - EUR	1.444.432	89.011.500	91.043.042	48,11%	0,34%
MKMINF20GL52 - DO2017/16-0632DK 8.6.2032 0:0:0 - EUR	1.989.788	122.771.500	124.965.506	40,92%	0,47%
MKMINF20GL60 - DO2017/17-0632DK 22.6.2032 0:0:0 - EUR	2.204.717	136.031.500	138.264.777	39,42%	0,52%
MKMINF20GL78 - DO2017/18-0632DK 29.6.2032 0:0:0 - EUR	2.302.305	142.051.500	144.281.192	15,78%	0,54%
MKMINF20GL86 - DO2017/19-0732DK 6.7.2032 0:0:0 - EUR	2.431.398	150.011.500	152.261.758	32,63%	0,57%
MKMINF20GL94 - DO2017/20-0732DK 20.7.2032 0:0:0 - EUR	1.624.716	100.011.500	101.603.260	86,21%	0,38%
MKMINF20GM02 - DO2017/21-0822DK 10.8.2022 0:0:0 - EUR	6.504.594	400.011.501	403.868.691	98,77%	1,52%
MKMINF20GM10 - DO2017/22-0832DK 10.8.2032 0:0:0 - EUR	13.009.188	800.011.501	811.721.403	81,41%	3,06%
MKMINF20GM28 - DO2017/23-0822DK 17.8.2022 0:0:0 - EUR	1.300.910	80.011.500	80.743.560	100,00%	0,30%
MKMINF20GM36 - DO2017/24-0832DK 17.8.2032 0:0:0 - EUR	6.504.552	400.011.500	405.573.729	45,43%	1,53%

MKMINF20GM77 - DO2017/27-0932DK 21.9.2032 0:0:0 - EUR	2.919.448	180.011.500	181.391.136	14,33%	0,68%
MKMINF20GN01 - DO2017/30-1032DK 5.10.2032 0:0:0 - EUR	6.506.710	400.011.500	403.683.635	35,67%	1,52%
MKMINF20GN27 - DO2017/32-1032DK 19.10.2032 0:0:0 - EUR	3.252.725	200.011.500	201.520.193	43,46%	0,76%
MKMINF20GN50 - DO2017/35-1132DK 2.11.2032 0:0:0 - EUR	3.578.458	220.011.499	221.382.898	41,46%	0,83%
MKMINF20GN68 - DO2017/36-1132DK 23.11.2032 0:0:0 - EUR	9.269.800	570.011.501	572.233.920	70,93%	2,16%
MKMINF20GN76 - DO2017/37-1132DK 30.11.2032 0:0:0 - EUR	350.266	21.565.821	21.612.148	17,25%	0,08%
MKMINF20GN84 - DO2017/38-1232DK 7.12.2032 0:0:0 - EUR	972.495	60.011.500	59.957.523	19,74%	0,23%
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		14.789.831.543	15.286.267.671		57,61%
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	3.000.000	164.116.848	158.392.192	0,01%	0,60%
US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	4.000.000	214.715.768	193.655.595	0,01%	0,73%
Обврзници и други хартии од вредност - издадени од странски единици на локална самоуправа					
Обврзници и други должнички хартии од вредност - издадени од странски компании и банки					

Вкупно инвестиции во обврзници издадени во странство		378.832.615	352.047.787		1,33%
Вкупно инвестиции во обврзници		15.168.664.157	15.638.315.458		58,94%

(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					
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	102.900	244.609.163	242.086.057	0,06%	0,91%
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	67.113	416.425.150	462.905.999	0,09%	1,74%
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	30.360	167.895.105	193.908.651	0,31%	0,73%
US4642865095 - ISHARES MSCI CANADA ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	114.320	168.542.828	173.733.019	0,11%	0,65%
US4642865251 - ISHARES EDGE MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	62.600	265.113.275	270.636.821	0,15%	1,02%
US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	117.309	197.096.116	203.898.008	0,85%	0,77%
US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	9.000	61.511.555	56.093.838	0,00%	0,21%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	31.225	203.362.485	246.005.733	0,34%	0,93%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	83.600	197.514.444	169.954.012	0,29%	0,64%
US46429B6065 - ISHARES MSCI POLAND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	22.500	23.778.379	31.251.688	0,16%	0,12%
US46434G8226 - ISHARES MSCI JAPAN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	154.800	444.146.424	475.660.608	0,05%	1,79%

US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	113.516	208.492.504	226.988.387	0,28%	0,86%
US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	47.000	59.608.658	56.003.599	0,01%	0,21%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	61.515	740.482.226	773.646.962	0,02%	2,92%
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		3.398.578.310	3.582.773.383		13,50%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови		3.398.578.310	3.582.773.383		13,50%

(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	115.819.671	115.998.343	0,44%
Долгорочни депозити	2.892.900.000	2.911.911.960	10,98%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	3.008.719.671	3.027.910.303	11,41%

7. Структура на инвестициите на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд 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	4.238.885.750	15,98%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	15.638.315.458	58,94%
Краткорочни хартии од вредност	0	0,00%
Акции и удели во инвестициони фондови	3.582.773.383	13,50%
Парични средства	962.713	0,00%
Пласмани и депозити	3.027.910.303	11,41%
Останати средства	43.148.828	0,16%
Вкупно средства	26.531.996.435	100,00%

8. Извештај за реализираните добивки и загуби на ОЗПФ НЛБ Пензиски Фонд 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	2.000	10.774.615	11.400.000	625.385
23.03.2017	MKALKA101011 - ALK	2.000	10.774.615	11.400.000	625.385
	Обични акции издадени од странски компании и банки	85.122	368.950.893	366.025.468	-2.925.425
16.03.2017	BE0974293251 - ABI	4.700	29.055.093	29.715.421	660.328
16.03.2017	CH0038863350 - NESN	7.000	29.274.992	30.860.390	1.585.398
16.03.2017	DE0006048408 - HEN	4.800	29.209.964	30.486.604	1.276.640
18.01.2017	DE0008404005 - ALV	900	8.687.294	8.786.184	98.890
04.08.2017	DE0008404005 - ALV	600	5.854.613	6.820.377	965.764
18.01.2017	DE000BASF111 - BAS	2.500	13.573.512	13.652.023	78.511
16.03.2017	FR0000120578 - SAN	10.000	47.279.043	50.846.349	3.567.307
18.01.2017	FR0000121014 - MC	1.100	12.267.959	12.634.912	366.953
20.01.2017	FR0000131104 - BNP	3.500	13.029.403	12.942.098	-87.306
15.02.2017	US0378331005 - AAPL	3.000	20.265.882	23.521.250	3.255.368
12.09.2017	US09075E1001 - BIVV	2.662	6.846.201	7.764.992	918.791
14.11.2017	US4062161017 - HAL	12.000	37.858.110	27.851.872	-10.006.238
05.12.2017	US4062161017 - HAL	11.300	35.649.720	25.878.446	-9.771.274
16.03.2017	US5184391044 - EL	4.000	17.845.362	19.782.748	1.937.386
08.11.2017	US5949181045 - MSFT	3.410	12.359.085	15.232.650	2.873.565
20.01.2017	US6934751057 - PNC	2.000	13.643.571	13.427.888	-215.684
24.02.2017	US9182041080 - VFC	11.650	36.251.089	35.821.264	-429.825
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	46.403	1.567.150	1.669.718	102.568

31.05.2017	MKMINF200D68 - РМДЕН06	8.658	0	11.403	11.403
31.05.2017	MKMINF200D76 - РМДЕН07	1.438	0	2.814	2.814
31.05.2017	MKMINF200D84 - РМДЕН08	9.307	0	20.782	20.782
27.09.2017	MKMINF200DF7 - РМДЕН15	27.000	1.567.150	1.634.719	67.569
	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки	1.000.000	61.887.056	60.234.550	-1.652.506
07.04.2017	FR0013131877 - FRTR 0 1/2 05/25/26	1.000.000	61.887.056	60.234.550	-1.652.506
	Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија	7.000	69.278.029	69.489.280	211.251
25.01.2017	MKMINFDYG105 - DZ2016/10-364	7.000	69.278.029	69.489.280	211.251
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	281.820	616.021.177	648.275.473	32.254.296
17.01.2017	US4642867075 - EWQ	13.860	19.943.119	20.273.923	330.804
18.01.2017	US4642867075 - EWQ	13.859	19.941.680	19.950.593	8.913
13.10.2017	US4642867646 - EWP	20.310	31.403.666	35.112.869	3.709.202
18.10.2017	US4642867646 - EWP	20.310	31.403.666	35.044.048	3.640.382
17.01.2017	US4642868065 - EWG	47.600	73.516.638	75.098.057	1.581.419
18.01.2017	US4642868065 - EWG	47.600	73.516.638	74.422.542	905.904
07.11.2017	US4642872919 - IXN	1.128	7.346.449	9.311.430	1.964.980
08.11.2017	US4642872919 - IXN	1.327	8.642.499	10.959.334	2.316.836
16.03.2017	US4642874659 - EFA	21.773	73.312.923	78.258.512	4.945.589
19.04.2017	US46429B6065 - EPOL	22.500	23.778.379	28.794.731	5.016.352
22.06.2017	US46434G8309 - EWI UP	22.553	31.846.361	34.326.438	2.480.077
28.06.2017	US46434G8309 - EWI UP	1.000	1.412.068	1.527.330	115.262
16.03.2017	US78463X8487 - CWI	35.000	64.283.780	69.111.527	4.827.747
17.01.2017	US9229083632 - VOO	6.500	77.836.655	78.421.597	584.942
18.01.2017	US9229083632 - VOO	6.500	77.836.655	77.662.541	-174.114
	ВКУПНО РЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ				28.615.569

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

9. Извештај за нереализирани добивки и загуби за ОЗПФ Пензиски Фонд 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	917.002.393	1.128.913.459	0	211.911.066	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	242.590.450	337.580.904	0	94.990.454	0	0	0
	МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	23.562.000	31.017.690	0	7.455.690	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	123.596.440	164.445.882	0	40.849.442	0	0	0
	МККМBS101019 - КОМЕРЦИЈАЛНА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	18.685.361	18.054.850	0	-630.511	0	0	0
	МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	119.154.040	125.962.100	0	6.808.060	0	0	0

	МКМТУР101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИС Т АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	145.072.373	160.781.176	0	15.708.803	0	0	0
	МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	42.358.640	50.976.000	0	8.617.360	0	0	0
	МКРРIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.924.000	79.838.000	0	5.914.000	0	0	0
	МКРЕРL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	79.619.810	101.325.200	0	21.705.390	0	0	0
	МКТЕТЕ101016 - ТЕТЕКС АД ТЕТОВО - ОБИЧНИ АКЦИИ	10.001.695	20.831.231	0	10.829.536	0	0	0
	МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	16.189.585	13.015.266	0	-3.174.319	0	0	0
	МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	13.823.000	16.323.160	0	2.500.160	0	0	0
	МКZRKO101012 - ЗК ПЕЛАГОНИЈА АД БИТОЛА - ОБИЧНИ АКЦИИ	8.425.000	8.762.000	0	337.000	0	0	0
	Приоритетни акции издадени во Република Македонија							
	Акции во затворени инвестициони фондови издадени во Република Македонија							

	Обични акции издадени од странски компании и банки	2.874.850.923	3.047.575.911	0	172.724.988	0	0	0
	BE0974293251 - ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	83.752.693	78.912.946	0	-4.839.747	0	0	0
	CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	104.109.171	106.259.813	0	2.150.642	0	0	0
	CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	55.032.803	57.945.069	0	2.912.266	0	0	0
	DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	103.399.851	101.178.550	0	-2.221.300	0	0	0
	DE0006048408 - HENKEL AG & CO. KGAA ST - ОБИЧНИ АКЦИИ	46.857.651	47.347.839	0	490.188	0	0	0
	DE0007164600 - SAP SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	48.288.966	48.843.600	0	554.634	0	0	0
	DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	114.335.210	114.188.611	0	-146.599	0	0	0
	DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	102.172.752	123.300.936	0	21.128.185	0	0	0
	DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	98.652.285	102.499.819	0	3.847.535	0	0	0
	FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	60.037.664	56.799.181	0	-3.238.483	0	0	0

	FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	126.116.516	130.207.411	0	4.090.895	0	0	0
	FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	91.440.903	123.721.416	0	32.280.513	0	0	0
	FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	120.220.381	123.676.091	0	3.455.710	0	0	0
	GB00B03MLX29 - ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS - ОБИЧНИ АКЦИИ	72.270.731	81.967.912	0	9.697.181	0	0	0
	NL0000235190 - AIRBUS SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	89.821.638	103.605.680	0	13.784.043	0	0	0
	US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	74.414.651	86.956.318	0	12.541.667	0	0	0
	US0231351067 - AMAZON.COM INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	86.932.676	107.930.340	0	20.997.663	0	0	0
	US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	81.440.635	85.150.050	0	3.709.414	0	0	0
	US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	89.250.946	114.637.808	0	25.386.861	0	0	0
	US09062X1037 - BIOGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	88.075.662	86.977.404	0	-1.098.258	0	0	0
	US1667641005 - CHEVRON CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	61.690.619	64.829.544	0	3.138.924	0	0	0
	US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.391.996	71.394.385	0	-1.997.611	0	0	0

	US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	98.419.976	50.997.894	0	-47.422.083	0	0	0
	US4370761029 - THE HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	73.041.819	90.762.571	0	17.720.752	0	0	0
	US4385161066 - HONEYWELL INTERNATIONAL INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	107.209.180	115.178.756	0	7.969.576	0	0	0
	US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	125.341.259	137.701.294	0	12.360.035	0	0	0
	US5184391044 - THE ESTEE LAUDER COMPANIES INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	58.889.694	86.115.146	0	27.225.453	0	0	0
	US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	95.030.856	114.996.305	0	19.965.449	0	0	0
	US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	119.400.877	130.353.918	0	10.953.041	0	0	0
	US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	117.426.723	108.595.463	0	-8.831.260	0	0	0
	US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	102.120.543	89.013.872	0	-13.106.672	0	0	0
	US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	106.263.595	105.529.967	0	-733.628	0	0	0

	Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	52.354.793	62.396.381	0	10.041.588	0	0	0
	US02079K1079 - ALPHABET INC - ПРИОРИТЕТНИ АКЦИИ	52.354.793	62.396.381	0	10.041.588	0	0	0
	Акции во затворени инвестициони фондови издадени од странски компании и банки							
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	14.789.831.543	15.286.267.671	1.146.956	30.475	-3.381.485	498.640.184	0
	MKMINF20G499 - DO2013/01-0118 9.1.2018 0:0:0 - MKD	184.751.011	195.098.041	0	0	0	10.347.030	0
	MKMINF20G507 - DO2013/03-0118 24.1.2018 0:0:0 - MKD	59.791.139	62.994.231	0	0	0	3.203.093	0
	MKMINF20GA71 - DO2014/25-1019 16.10.2019 0:0:0 - MKD	67.846.198	70.570.552	0	0	0	2.724.354	0
	MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	239.507.669	245.850.017	0	0	0	6.342.348	0
	MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	7.911.062	8.479.268	168.097	3.213	30.775	366.122	0
	MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	22.597.922	23.575.942	-258.391	27.262	43.410	1.165.739	0

	MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	75.740.188	77.226.377	-2.908.727	0	103.941	4.290.975	0
	MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	47.261	49.753	633	0	53	1.806	0
	MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	115.812	120.327	288	0	96	4.131	0
	MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	33.594.873	35.277.540	-19.894	0	26.707	1.675.854	0
	MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	71.345.992	75.254.771	648.258	0	51.021	3.209.501	0
	MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	91.362.441	95.639.675	870.236	0	59.638	3.347.360	0
	MKMINF200DF7 - RMDEN15 31.5.2026 0:0:0 - EUR	171.338.301	180.537.172	2.646.457	0	103.983	6.448.431	0
	MKMINF20G481 - DO2013/02-0118-DK 9.1.2018 0:0:0 - EUR	430.259.626	453.580.295	0	0	40.075	23.280.593	0
	MKMINF20G523 - DO2013/05-0218-DK 28.2.2018 0:0:0 - EUR	59.365.203	62.453.131	0	0	6.869	3.081.059	0
	MKMINF20G549 - DO2013/07-0318-DK 7.3.2018 0:0:0 - EUR	79.016.601	83.131.057	0	0	7.673	4.106.784	0
	MKMINF20G556 - DO2013/08-0318-DK 14.3.2018 0:0:0 - EUR	88.771.558	93.398.499	0	0	8.493	4.618.448	0
	MKMINF20G572 - DO2013/10-0418-DK 4.4.2018 0:0:0 - EUR	78.690.756	82.818.736	0	0	20.827	4.107.153	0

	MKMINF20G580 - DO2013/11-0418-DK 25.4.2018 0:0:0 - EUR	58.909.877	61.849.712	0	0	7.228	2.932.606	0
	MKMINF20G606 - DO2013/13-0518-DK 30.5.2018 0:0:0 - EUR	175.863.646	184.700.982	0	0	38.874	8.798.462	0
	MKMINF20G671 - DO2013/20-0718DK 18.7.2018 0:0:0 - EUR	116.583.564	122.099.787	0	0	16.402	5.499.822	0
	MKMINF20G705 - DO2013/23-0718DK 25.7.2018 0:0:0 - EUR	58.284.891	61.045.230	0	0	7.174	2.753.165	0
	MKMINF20G721 - DO2013/25-0818DK 30.8.2018 0:0:0 - EUR	179.272.105	187.818.341	0	0	37.152	8.509.084	0
	MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	231.533.112	242.590.421	0	0	18.342	11.038.966	0
	MKMINF20G762 - DO2013/29-1018DK 17.10.2018 0:0:0 - EUR	57.785.654	60.549.969	0	0	5.085	2.759.229	0
	MKMINF20G770 - DO2013/30-1018DK 31.10.2018 0:0:0 - EUR	76.908.336	80.593.492	0	0	7.063	3.678.093	0
	MKMINF20G788 - DO2013/31-1118DK 21.11.2018 0:0:0 - EUR	134.212.446	140.661.359	0	0	12.671	6.436.242	0
	MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	86.092.264	90.250.329	0	0	21.785	4.136.279	0
	MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	95.192.232	99.786.042	0	0	8.935	4.584.875	0

	MKMINF20G838 - DO2014/01-0119DK 23.1.2019 0:0:0 - EUR	99.429.600	104.025.113	0	0	10.274	4.585.239	0
	MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	44.524.228	46.592.033	0	0	5.164	2.062.641	0
	MKMINF20G903 - DO2014/08-0319DK 27.3.2019 0:0:0 - EUR	29.567.891	30.949.933	0	0	7.327	1.374.715	0
	MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	147.191.583	154.095.975	0	0	27.237	6.877.154	0
	MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	88.333.382	92.489.482	0	0	22.520	4.133.580	0
	MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	293.074.543	306.911.341	0	0	74.430	13.762.368	0
	MKMINF20G960 - DO2014/14-0619DK 19.6.2019 0:0:0 - EUR	58.510.491	61.276.649	0	0	14.867	2.751.291	0
	MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	209.972.477	220.598.503	0	0	27.107	10.598.919	0
	MKMINF20GA06 - DO2014/18-0824DK 21.8.2024 0:0:0 - EUR	72.869.320	76.595.563	0	0	6.940	3.719.304	0
	MKMINF20GA14 - DO2014/19-0924DK 4.9.2024 0:0:0 - EUR	48.293.505	50.806.563	0	0	12.593	2.500.464	0
	MKMINF20GA89 - DO2014/26-1019DK 16.10.2019 0:0:0 - EUR	320.843.501	332.569.036	0	0	34.689	11.690.845	0
	MKMINF20GC79 - DO2015/05-0230DK 12.2.2030 0:0:0 - EUR	129.353.151	134.578.666	0	0	25.153	5.200.362	0

	MKMINF20GD03 - DO2015/08-0230DK 26.2.2030 0:0:0 - EUR	49.680.499	51.686.870	0	0	6.011	2.000.360	0
	MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	257.197.416	267.599.676	0	0	27.881	10.374.380	0
	MKMINF20GD52 - DO2015/13-0330DK 26.3.2030 0:0:0 - EUR	59.236.747	61.643.729	0	0	13.945	2.393.037	0
	MKMINF20GD78 - DO2015/15-0430DK 16.4.2030 0:0:0 - EUR	167.671.621	174.478.625	0	0	18.319	6.788.685	0
	MKMINF20GD94 - DO2015/17-0530DK 7.5.2030 0:0:0 - EUR	88.642.491	92.260.075	0	0	20.519	3.597.065	0
	MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	177.384.072	183.711.886	0	0	32.936	6.294.878	0
	MKMINF20GE36 - DO2015/21-0625DK 25.6.2025 0:0:0 - EUR	117.570.183	121.782.536	0	0	27.030	4.185.323	0
	MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	185.889.240	192.550.106	0	0	32.338	6.628.528	0
	MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	185.390.287	193.000.928	0	0	32.767	7.577.874	0
	MKMINF20GE93 - DO2015/27-0725DK 23.7.2025 0:0:0 - EUR	136.802.763	141.704.949	0	0	18.635	4.883.551	0
	MKMINF20GF27 - DO2015/30-0825DK 6.8.2025 0:0:0 - EUR	68.490.803	70.946.418	0	0	7.786	2.447.830	0
	MKMINF20GF76 - DO2015/35-0825DK 27.8.2025 0:0:0 - EUR	117.243.018	121.461.540	0	0	19.385	4.199.137	0

	MKMINF20GG34 - DO2015/41-1030DK 29.10.2030 0:0:0 - EUR	260.297.473	271.098.621	0	0	26.815	10.774.333	0
	MKMINF20GH09 - DO2016/02-0131DK 14.1.2031 0:0:0 - EUR	99.704.140	103.709.937	0	0	10.852	3.994.945	0
	MKMINF20GH17 - DO2016/03-0131DK 22.1.2031 0:0:0 - EUR	149.132.696	155.579.927	0	0	15.900	6.431.332	0
	MKMINF20GH74 - DO2016/07-0231DK 11.2.2031 0:0:0 - EUR	69.422.618	72.437.383	0	0	13.708	3.001.057	0
	MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	118.523.617	123.682.603	0	0	13.642	5.145.344	0
	MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	147.881.807	154.350.408	0	0	36.477	6.432.124	0
	MKMINF20GI24 - DO2016/12-0431DK 14.4.2031 0:0:0 - EUR	83.720.588	87.377.178	0	0	9.826	3.646.764	0
	MKMINF20GI32 - DO2016/13-0631DK 9.6.2031 0:0:0 - EUR	78.212.561	81.662.085	0	0	19.183	3.430.341	0
	MKMINF20GI81 - DO2016/18-0826DK 18.8.2026 0:0:0 - EUR	136.720.458	141.916.701	0	0	15.094	5.181.149	0
	MKMINF20GI99 - DO2016/19-0831DK 18.8.2031 0:0:0 - EUR	136.183.750	142.220.749	0	0	14.028	6.022.972	0
	MKMINF20GJ15 - DO2016/21-0931DK 22.9.2031 0:0:0 - EUR	135.551.521	141.597.782	0	0	23.429	6.022.833	0
	MKMINF20GJ23 - DO2016/22-0931DK 29.9.2031 0:0:0 - EUR	338.666.505	353.758.204	0	0	30.916	15.060.783	0

	MKMINF20GJ64 - DO2016/26-1131DK 3.11.2031 0:0:0 - EUR	259.824.631	271.452.453	0	0	24.662	11.603.160	0
	MKMINF20GJ80 - DO2016/28-1231DK 1.12.2031 0:0:0 - EUR	257.802.483	269.408.675	0	0	53.184	11.553.007	0
	MKMINF20GJ98 - DO2016/29-1231DK 22.12.2031 0:0:0 - EUR	686.528.801	717.441.410	0	0	70.220	30.842.389	0
	MKMINF20GK04 - DO2017/02-0132DK 12.1.2032 0:0:0 - EUR	444.506.016	456.087.500	0	0	-636.713	12.218.198	0
	MKMINF20GK46 - DO2017/05-0132DK 26.1.2032 0:0:0 - EUR	199.761.501	206.697.281	0	0	-106.909	7.042.689	0
	MKMINF20GK53 - DO2017/06-0232DK 16.2.2032 0:0:0 - EUR	439.931.500	454.014.346	0	0	-443.740	14.526.587	0
	MKMINF20GK79 - DO2017/08-0332DK 9.3.2032 0:0:0 - EUR	150.011.500	154.618.821	0	0	-17.208	4.624.529	0
	MKMINF20GK95 - DO2017/10-0332DK 23.3.2032 0:0:0 - EUR	150.011.500	154.078.030	0	0	-327.838	4.394.369	0
	MKMINF20GL11 - DO2017/12-0432DK 6.4.2032 0:0:0 - EUR	190.011.501	194.651.960	0	0	-639.941	5.280.401	0
	MKMINF20GL37 - DO2017/14-0532DK 4.5.2032 0:0:0 - EUR	89.011.500	91.043.042	0	0	-183.986	2.215.528	0
	MKMINF20GL52 - DO2017/16-0632DK 8.6.2032 0:0:0 - EUR	122.771.500	124.965.506	0	0	-409.582	2.603.588	0
	MKMINF20GL60 - DO2017/17-0632DK 22.6.2032 0:0:0 - EUR	136.031.500	138.264.777	0	0	-453.187	2.686.464	0

	MKMINF20GL78 - DO2017/18-0632DK 29.6.2032 0:0:0 - EUR	142.051.500	144.281.192	0	0	-472.216	2.701.907	0
	MKMINF20GL86 - DO2017/19-0732DK 6.7.2032 0:0:0 - EUR	150.011.500	152.261.758	0	0	-493.969	2.744.227	0
	MKMINF20GL94 - DO2017/20-0732DK 20.7.2032 0:0:0 - EUR	100.011.500	101.603.260	0	0	-96.437	1.688.197	0
	MKMINF20GM02 - DO2017/21-0822DK 10.8.2022 0:0:0 - EUR	400.011.501	403.868.691	0	0	-31.381	3.888.571	0
	MKMINF20GM10 - DO2017/22-0832DK 10.8.2032 0:0:0 - EUR	800.011.501	811.721.403	0	0	-66.262	11.776.165	0
	MKMINF20GM28 - DO2017/23-0822DK 17.8.2022 0:0:0 - EUR	80.011.500	80.743.560	0	0	-6.794	738.854	0
	MKMINF20GM36 - DO2017/24-0832DK 17.8.2032 0:0:0 - EUR	400.011.500	405.573.729	0	0	-35.713	5.597.942	0
	MKMINF20GM77 - DO2017/27-0932DK 21.9.2032 0:0:0 - EUR	180.011.500	181.391.136	0	0	-481.909	1.861.545	0
	MKMINF20GN01 - DO2017/30-1032DK 5.10.2032 0:0:0 - EUR	400.011.500	403.683.635	0	0	100.550	3.571.585	0
	MKMINF20GN27 - DO2017/32-1032DK 19.10.2032 0:0:0 - EUR	200.011.500	201.520.193	0	0	11.530	1.497.163	0
	MKMINF20GN50 - DO2017/35-1132DK 2.11.2032 0:0:0 - EUR	220.011.499	221.382.898	0	0	40.929	1.330.470	0

	MKMINF20GN68 - DO2017/36-1132DK 23.11.2032 0:0:0 - EUR	570.011.501	572.233.920	0	0	3.983	2.218.436	0
	MKMINF20GN76 - DO2017/37-1132DK 30.11.2032 0:0:0 - EUR	21.565.821	21.612.148	0	0	-22.011	68.338	0
	MKMINF20GN84 - DO2017/38-1232DK 7.12.2032 0:0:0 - EUR	60.011.500	59.957.523	0	0	-200.742	146.766	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	378.832.615	352.047.787	13.377.255	0	-45.600.889	5.438.806	0
	US912810RU43 - T 2 7/8 11/15/46 15.11.2046 0:0:0 - USD	164.116.848	158.392.192	10.001.157	0	-18.481.006	2.755.193	0
	US912828R366 - T 1 5/8 05/15/26 15.5.2026 0:0:0 - USD	214.715.768	193.655.595	3.376.098	0	-27.119.883	2.683.612	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 компаниии и банки							
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	3.398.578.310	3.582.773.383	0	184.195.073	0	0	0
	DE0002635307 - ISHARES STOXX EUROPE 600 UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	244.609.163	242.086.057	0	-2.523.105	0	0	0
	DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	416.425.150	462.905.999	0	46.480.849	0	0	0
	US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	167.895.105	193.908.651	0	26.013.546	0	0	0

	US4642865095 - ISHARES MSCI CANADA ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	168.542.828	173.733.019	0	5.190.192	0	0	0
	US4642865251 - ISHARES EDGE MSCI MIN VOL GLOBAL ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	265.113.275	270.636.821	0	5.523.546	0	0	0
	US4642867562 - ISHARES MSCI SWEDEN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	197.096.116	203.898.008	0	6.801.892	0	0	0
	US4642872422 - ISHARES IBOXX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	61.511.555	56.093.838	0	-5.417.718	0	0	0
	US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	203.362.485	246.005.733	0	42.643.248	0	0	0
	US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	197.514.444	169.954.012	0	-27.560.431	0	0	0

	US46429B6065 - ISHARES MSCI POLAND ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	23.778.379	31.251.688	0	7.473.309	0	0	0
	US46434G8226 - ISHARES MSCI JAPAN ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	444.146.424	475.660.608	0	31.514.184	0	0	0
	US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX- US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	208.492.504	226.988.387	0	18.495.884	0	0	0
	US92189F1066 - VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	59.608.658	56.003.599	0	-3.605.059	0	0	0
	US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	740.482.226	773.646.962	0	33.164.736	0	0	0
	Други ненаведени хартии од вредност издадени од странски влади и компании							
	ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	22.411.450.575	23.459.974.591	14.524.211	578.903.190	-48.982.374	504.078.989	0

Забелешка: Вкупната разлика помеѓу објективната (фер) вредност и трошокот на набавка е еднаква вкупно нерелизираниите 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	962.713	0	0	0	0	0	962.713
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	7.821.659.133	1.223.196	7.822.882.329
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	9.996.180.034	9.996.180.034
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	6.163.257	428.935.689	1.249.000.000	0	0	6.984.723.585	8.668.822.531
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	43.148.828	0	43.148.828
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	7.125.970	428.935.689	1.249.000.000	0	7.864.807.961	16.982.126.815	26.531.996.435
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	12.961.822	0	12.961.822
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	12.961.822	0	12.961.822
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	7.125.970	428.935.689	1.249.000.000	0	7.851.846.139	16.982.126.815	26.519.034.613

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	4,28	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти расположливи за продавање	4,09	4,08	2,56	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	3,29	4,04	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	962.713	0	0	0	962.713
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	7.822.882.329	0	0	0	7.822.882.329
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	9.996.180.034	0	0	0	9.996.180.034
4) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	62.043.355	594.529.127	2.469.900.000	5.542.350.049	8.668.822.531
5) Останати средства на пензискиот фонд	43.148.828	0	0	0	43.148.828
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	17.925.217.259	594.529.127	2.469.900.000	5.542.350.049	26.531.996.435
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	12.666.192	295.630	0	0	12.961.822
8) Вкупно обврски (6+7)	12.666.192	295.630	0	0	12.961.822
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	17.912.551.067	594.233.497	2.469.900.000	5.542.350.049	26.519.034.613
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	17.912.551.067	18.506.784.564	20.976.684.564	26.519.034.613	

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	962.713	0	0	0	0	962.713
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	1.128.913.459	1.942.465.247	4.587.298.741	0	164.204.882	7.822.882.329
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	574.512.842	9.069.619.405	352.047.787	0	0	9.996.180.034
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	2.927.787.900	5.640.912.294	65.476.601	0	34.645.736	8.668.822.531
5) Останати средства на пензискиот фонд	35.153.311	0	7.995.517	0	0	43.148.828
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	4.667.330.225	16.652.996.946	5.012.818.646	0	198.850.618	26.531.996.435
Обврски	10.267.537	0	2.694.285	0	0	12.961.822

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=2a+2б)				2) Вложувања во финансиски инструменти кои се предмет на тестирање за оштетување во текот на периодот		
2a) 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 (MCC 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