



Administrator de Fond	NN ASIGURARI DE VIATA SA
Cod administrator	SAA-RO-9112925
Fond de pensii	NN Activ
Cod fond	FP3 -1011
Depozitar	BRD -Groupe Societe Generale SA
Cod depozitar	DEP-RO-373958

Structura portofoliului de investiții  
la data de 30/06/2016

Portofoliul de instrumente financiare	Denumire Emitent	ISIN / Denumire instrument	Valoare actualizata (lei)	Pondere in activul total al fondului (%)
<b>1. Instrumente ale pieței monetare, din care:</b>			<b>6.104.477,16</b>	<b>4,040835076</b>
a. Conturi curente			<b>252.827,33</b>	<b>0,167358074</b>
	Banca Comerciala Romana	Sold conturi in numele fondului	61,76	4,08818E-05
	BRD - Groupe Societe Generale SA	Sold conturi in numele fondului	252.220,47	0,166956366
	Citibank Romania	Sold conturi in numele fondului	-	0
	Garanti Bank SA	Sold conturi in numele fondului	202,74	0,000134203
	OTP Bank	Sold conturi in numele fondului	202,04	0,00013374
	Raiffeisen Bank SA	Sold conturi in numele fondului	16,78	1,11075E-05
	Unicredit Bank SA	Sold conturi in numele fondului	123,54	8,17768E-05
b. Depozite în lei și valută convertibilă			<b>5.851.649,83</b>	<b>3,873477001</b>
	BRD - Groupe Societe Generale SA	Sold depozite in numele fondului	382.283,02	0,253050768
	Citibank Romania	Sold depozite in numele fondului	596.583,92	0,394906421
	Unicredit Bank SA	Sold depozite in numele fondului	400.505,28	0,265112923
	Garanti Bank SA	Sold depozite in numele fondului	4.472.277,61	2,960406888
<b>2. Valori mobiliare tranzacționate, din care:</b>			<b>139.791.527,87</b>	<b>92,53446189</b>
a. Titluri de stat cu scadența mai mare de 1 an			<b>83.117.200,53</b>	<b>55,01910983</b>
	Ministerul Finantelor Publice	RO0717DBN038	15.252.317,80	10,09621285
	Ministerul Finantelor Publice	RO1121DBN032	6.145.955,10	4,068291238
	Ministerul Finantelor Publice	RO1217DBN046	6.646.492,46	4,39962001
	Ministerul Finantelor Publice	RO1318DBN034	4.521.944,70	2,993283827
	Ministerul Finantelor Publice	RO1320DBN022	7.386.256,30	4,889303826
	Ministerul Finantelor Publice	RO1323DBN018	4.343.790,33	2,8735523
	Ministerul Finantelor Publice	RO1418DBN040	1.257.229,97	0,832218522
	Ministerul Finantelor Publice	RO1419DBE013	3.446.694,66	2,281526216
	Ministerul Finantelor Publice	RO1419DBN014	4.496.445,41	2,97640467
	Ministerul Finantelor Publice	RO1425DBN029	4.729.579,52	3,130726894
	Ministerul Finantelor Publice	RO1227DBN011	4.893.846,93	3,239463071
	Ministerul Finantelor Publice	RO1521DBN041	414.389,64	0,274303621
	Ministerul Finantelor Publice	RO1620DBN017	1.083.626,26	0,717302217
	Ministerul Finantelor Publice	RO1522DBN056	1.516.079,27	1,003562816
	Ministerul Finantelor Publice	RO1519DBN037	4.589.168,72	3,037782507
	Ministerul Finantelor Publice	XS1313004928	1.457.785,26	0,964975322
	Ministerul Finantelor Publice	XS1420357318	2.287.503,07	1,514203821
	Ministerul Finantelor Publice	XS1060842975	1.260.515,18	0,834393154
	Ministerul Finantelor Publice	XS1312891549	7.387.579,95	4,890180011
b. Obligațiuni emise de administrația publică locală			<b>4.031.143,16</b>	<b>2,668399643</b>
	Bacau - Romania	ROBACADBL033	621,51	0,000411406
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL012	1.015.159,32	0,671980791
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL020	1.532.908,15	1,014702629
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL038	503.514,73	0,333299631
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL046	555.810,26	0,367916455
	Timisoara - Romania	ROTIMYDBL037	423.129,19	0,28088733
c. Obligațiuni corporative tranzacționate			<b>9.847.434,62</b>	<b>6,518471308</b>
	Banca Comerciala Romana	XS0496326223	292.441,67	0,193580634
	Garanti Bank SA	ROGABRDBCO11	402.765,05	0,266608769
	GDF Suez	ROGSEDRDBC017	1.197.411,67	0,79262203
	KfW	XS1242404330	769.502,57	0,509369254
	Lloyds TSB Bank PLC	XS0483065271	1.100.183,18	0,728262006
	Raiffeisen Bank SA	RORFZBDBC036	862.555,55	0,570965314
	FCE Bank PLC	XS1412585165	501.553,42	0,332001349
	Intesa SanPaolo SpA	XS1372163888	2.520.621,23	1,668515487
	Unicredit Bank Austria AG	XS1272229169	1.024.269,13	0,678010994
	Royal Bank of Scotland PLC	XS0383926549	1.176.131,15	0,778535472
d. Acțiuni			<b>42.795.749,56</b>	<b>28,32848111</b>
	AT S Austria Technologie Systemtechnik	AT0000969985	200.004,52	0,132392219
	UNIWEELS AG	DE000A13STW4	172.945,56	0,114480645
	Banca Transilvania SA	ROTLVAACNOR1	6.148.646,40	4,070072733
	BRD - Groupe Societe Generale SA	ROBRDBACNOR2	3.479.245,00	2,303072788
	Bursa de Valori Bucuresti SA	ROBVBAACNOR0	444.250,80	0,294070101
	Compa SA	ROCMPSACNOR9	436.763,60	0,289113978
	Concefa SA	ROCOFIACNOR7	-	0
	DO & CO AG	AT0000818802	321.392,92	0,212744802
	Electrica SA	ROELECACNOR5	5.083.317,76	3,364882555
	Erste Group Bank AG	AT0000652011	426.786,38	0,282509596
	Fondul Proprietatea SA	ROFPTAACNOR5	6.505.960,43	4,306595375
	OMV Petrom SA	ROSNPPACNOR9	4.721.376,24	3,125296764
	Romgaz SA	ROSGNACNOR3	5.158.727,70	3,414799874
	SIF 2 Moldova	ROSIFBACNOR0	355.000,00	0,234990879
	SIF 4 Muntenia	ROSIFDACNOR6	439.845,00	0,291153699
	SIF 5 Oltenia	ROSIFEACNOR4	1.086.708,00	0,719342163
	Teraplast SA	ROTRPLACNOR7	225.101,89	0,149005327
	Transelectrica SA	ROTSSELACNOR9	1.926.148,80	1,275006758
	Transgaz SA	ROTGNTACNOR8	4.177.648,00	2,765377956
	Vrancart SA	ROVRJUACNOR7	439.096,38	0,290658153
	Zentiva SA	ROSCDBACNOR8	1.046.784,18	0,692914744
e. Obligațiuni BERD, BEI, BM			-	-
f. Alte obligațiuni emise de organisme străine neguvernamentale (investment grade)			-	0
<b>3. OPCVM</b>			<b>4.850.411,45</b>	<b>3,210711123</b>
	THEAM Quant Equity Europe Guru / BNI LU1235105779		1.270.328,75	0,840889209
	db x - trackers Euro Stoxx 50 UCITS ETF / LU0380865021		3.580.082,70	2,369821914
<b>4. Instrumente de acoperire a riscului, din care:</b>			<b>100.785,06</b>	<b>-0,066714281</b>
a. Futures			-	-
b. Options			-	-
c. Swaps			-	-
d. Forward			-	-
	Citibank Romania		100.785,06	-0,066714281
<b>5. Private equity</b>			-	-
<b>6. Alte instrumente financiare</b>			<b>424.061,99</b>	<b>0,280706196</b>