



Administrator de Fond	NN Pensii S.A.F.P.A.P. S.A
Cod administrator	SAP-RO-21784526
Fond de pensii	FONDUL DE PENSII ADMINISTRAT PRIVAT NN
Cod fond	FP2-31
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 (%)
1. Instrumente ale pieței monetare, din care:			741.370.836,69	7,294446401
a. Conturi curente			1.578.785,72	0,015533883
	Banca Comerciala Romana	Sold conturi in numele fondului	123.548,86	0,001215614
	BRD - Groupe Societe Generale SA	Sold conturi in numele fondului	1.424.359,85	0,014014466
	Citibank Romania	Sold conturi in numele fondului	9.646,15	9,49098E-05
	Garanti Bank SA	Sold conturi in numele fondului	20.969,22	0,000206319
	Raiffeisen Bank SA	Sold conturi in numele fondului	99,75	9,81454E-07
	Unicredit Bank SA	Sold conturi in numele fondului	161,89	1,59286E-06
b. Depozite în lei și valută convertibilă			739.792.050,97	7,278912518
	BRD - Groupe Societe Generale SA	Sold depozite in numele fondului	1.265.553,03	0,012451945
	Citibank Romania	Sold depozite in numele fondului	4.397.445,34	0,04326705
	Garanti Bank SA	Sold depozite in numele fondului	334.161.863,20	3,287863077
	Unicredit Bank SA	Sold depozite in numele fondului	399.967.189,40	3,935330446
2. Valori mobiliare tranzacționate, din care:			9.001.195.695,97	88,56396327
a. Titluri de stat cu scadența mai mare de 1 an			6.690.693.038,59	65,8306199
	Ministerul Finantelor Publice	RO0520DBN0L3	7.874.286,00	0,077476149
	Ministerul Finantelor Publice	RO0717DBN038	797.714.214,51	7,8488164
	Ministerul Finantelor Publice	RO1121DBN032	752.862.203,11	7,407511486
	Ministerul Finantelor Publice	RO1217DBN046	415.018.066,63	4,083418032
	Ministerul Finantelor Publice	RO1227DBN011	165.357.923,41	1,626978632
	Ministerul Finantelor Publice	RO1318DBN034	348.223.656,44	3,426218934
	Ministerul Finantelor Publice	RO1320DBN022	831.237.920,68	8,178660609
	Ministerul Finantelor Publice	RO1323DBN018	645.154.346,92	6,347759544
	Ministerul Finantelor Publice	RO1418DBN040	182.298.345,25	1,793657698
	Ministerul Finantelor Publice	RO1419DBE013	149.192.640,17	1,467926257
	Ministerul Finantelor Publice	RO1419DBN014	344.465.640,31	3,389243312
	Ministerul Finantelor Publice	RO1425DBN029	446.093.940,50	4,389177693
	Ministerul Finantelor Publice	RO1521DBN041	69.410.265,34	0,682936845
	Ministerul Finantelor Publice	XS1420357318	68.625.091,98	0,67521142
	Ministerul Finantelor Publice	RO1522DBN056	73.715.879,95	0,725300361
	Ministerul Finantelor Publice	RO1621DBE048	110.519.909,45	1,087420109
	Ministerul Finantelor Publice	RO1620DBN017	122.374.165,34	1,204055711
	Ministerul Finantelor Publice	RO1519DBN037	325.626.562,04	3,203883112
	Ministerul Finantelor Publice	US77586TAA43	70.421.708,06	0,692888565
	Ministerul Finantelor Publice	US77586TAE64	10.356.293,25	0,101896949
	Ministerul Finantelor Publice	XS0852474336	153.534.612,61	1,510647502
	Ministerul Finantelor Publice	XS0972758741	167.252.990,65	1,64562445
	Ministerul Finantelor Publice	XS1060842975	147.424.813,77	1,450532377
	Ministerul Finantelor Publice	XS1129788524	77.412.991,56	0,761676734
	Ministerul Finantelor Publice	XS1313004928	69.439.171,15	0,683221253
	Ministerul Finantelor Publice	XS1312891549	139.085.399,51	1,36847977
b. Obligațiuni emise de administrația publică locală			202.823.241,29	1,995604884
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL012	85.273.382,47	0,839016167
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL020	56.206.632,19	0,55302454
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL038	30.059.829,14	0,295762662
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL046	30.316.923,29	0,298292246
	Timisoara - Romania	ROTIMYDBL037	966.474,20	0,009509268
c. Obligațiuni corporative tranzacționate			427.251.214,72	4,203781605
	Banca Comerciala Romana	XS0474834925	20.121.058,20	0,197973771
	Banca Comerciala Romana	XS0496326223	21.055.800,00	0,207170821
	DnB NOR Bank	XS0301678644	22.242.836,95	0,218850235
	Garanti Bank SA	ROGABRDBC011	28.495.627,64	0,280372276
	GDF Suez	ROGSEDRBC017	26.132.984,44	0,257125914
	FCE Bank PLC	XS1412585165	30.093.205,48	0,296091057
	Intesa SanPaolo SpA	XS1372163888	50.412.424,66	0,49601456
	JPMorgan Chase & Co	XS1190880465	45.171.839,04	0,44445174
	KBC Ifima NV	XS0446546367	3.507.972,50	0,034515409
	KFW	XS1242404330	69.255.231,40	0,681411445
	Lloyds TSB Bank PLC	XS0483065271	16.771.439,59	0,165016428
	Unicredit Bank Austria AG	XS1272229169	30.215.939,21	0,29729865
	Raiffeisen Bank SA	RORFZBDBC036	29.567.093,97	0,290914575
	Transelectrica SA	ROTSLEDBC013	18.425.976,67	0,181295639
	Unicredit Tiriack Bank SA	ROUCTBDBC014	15.781.784,97	0,155279084
d. Acțiuni			1.638.474.317,49	16,12116703
	Alumil ROM Industry	ROALUMACNOR8	1.236.442,96	0,012165527
	Andritz AG	AT0000730007	13.268.250,74	0,130548086
	AT S Austria Technologie Systemtechnik AG	AT0000969985	6.862.301,39	0,067519097
	Banca Comerciala Carpatina	ROBACRACNOR6	2.507.227,61	0,024668946
	Banca Transilvania SA	ROTLVAACNOR1	324.975.000,48	3,197472311

Bank Polska Kasa Opieki	PLPEKA000016	9.285.762,45	0,091363853
BRD - Groupe Societe Generale SA	ROBRDBACNOR2	146.961.584,00	1,445974598
Bursa de Valori Bucuresti SA	ROBVBAACNOR0	13.367.650,80	0,131526097
CEZ SA	CZ0005112300	6.753.940,43	0,066452919
Compa SA	ROCMP5ACNOR9	10.524.456,75	0,103551532
Concefa SA	ROCOFIACNOR7	-	0
DO & CO AG	AT0000818802	7.111.308,76	0,069969114
EFO Turism Hoteluri Restaurante Marea Neagra SA	ROEFRIACNOR6	683.532,00	0,006725362
Electrica SA	ROELECACNOR5	155.225.422,72	1,527283608
Erste Group Bank AG	AT0000652011	34.227.845,18	0,336772327
Fondul Proprietatea SA	ROFPTAACNOR5	245.634.333,98	2,416828927
Integerpl SA	PLINTEG00011	1.721.017,66	0,016933322
Oil Terminal SA	ROOILTACNOR9	1.137.315,60	0,0111902
OMV	AT0000743059	20.361.120,85	0,20033578
OMV Petrom SA	ROSNPACNOR9	145.527.715,44	1,431866574
OTP Bank Nyrt	HU0000061726	8.084.509,80	0,079544569
Pegas Nonwovens SA	LU0275164910	4.889.742,67	0,048110829
PKP Cargo SA	PLPKPCR00011	606.083,93	0,005963341
Polski Koncern Naftowy Orlen SA	PLPKN0000018	1.655.777,57	0,016291416
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	PLPKO0000016	4.986.607,37	0,049063894
Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	PLPZU0000011	4.773.347,02	0,046965597
Prodplast SA	ROPRLAACNOR7	47.687,76	0,000469206
Richter Gedeon Nyrt	HU0000123096	4.210.281,58	0,041425521
Romcarbon SA	ROROCEACNOR1	989.300,00	0,009733854
Romgaz SA	ROSGNACNOR3	154.683.870,40	1,521955202
Ropharma SA	ROIAFRACNOR4	6.797.708,94	0,066883564
SIF 2 Moldova	ROSIFBACNOR0	1.803.400,00	0,017743893
SIF 4 Muntenia	ROSIFDACNOR6	17.023.742,00	0,167498865
SIF 5 Oltenia	ROSIFEACNOR4	29.899.551,50	0,294185669
Teraplast SA	ROTRPLACNOR7	6.193.915,92	0,060942764
Transelectrica SA	ROTSSELACNOR9	63.575.827,20	0,625531031
Transgaz SA	ROTGNTACNOR8	108.850.048,00	1,070990119
Voestalpine AG	AT0000937503	3.038.373,04	0,029894957
Vrancart SA	ROVRJUACNOR7	6.466.039,49	0,063620224
Wiener Staedtsche Versicherung AG	AT0000908504	6.309.432,30	0,062079345
Wizz Air Holdings Plc	JE00BN574F90	5.559.830,38	0,054703912
UNIWHEELS AG	DE000A13STW4	7.346.880,00	0,072286931
Work Service SA	PLWRKSR00019	1.561.596,08	0,015364752
Zentiva SA	ROSCDBACNOR8	41.748.534,74	0,410769394
e. Obligatiuni BERD, BEI, BM		41.953.883,88	0,412789851
European Bank for Reconstruction and Developmen	XS0411088353	5.400.690,28	0,053138111
European Bank for Reconstruction and Developmen	XS0978719572	36.553.193,60	0,35965174
f. Alte obligatiuni emise de organisme straine neguvernamentale (investment grade)		-	-
3. OPCVM		414.196.968,94	4,075339142
THEAM Quant Equity Europe Guru / BNP Paribas	LU1235105779	98.073.848,33	0,964961656
db x - trackers Euro Stoxx 50 UCITS ETF / Deutsche F	LU0380865021	174.680.363,55	1,718703362
ERSTE BOND FLEXIBLE RON/SAI ERSTE ASSET MANA	ROFDIN000010	138.536.759,45	1,363081627
ERSTE EQUITY ROMANIA/SAI ERSTE ASSET MANAGE	ROFDIN0000G4	2.905.997,61	0,028592498
4. Instrumente de acoperire a riscului, din care:		-	-0,050431837
a. Futures		-	-
b. Options		-	-
c. Swaps		-	-
d. Forward		-	-
Citibank Romania		5.125.638,26	-0,050431837
5. Private equity		-	-
6. Alte instrumente financiare		11.859.075,46	0,116683023