



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 31/12/2015

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>452.296.442,46</b>	<b>4,948269448</b>
a. Conturi curente			<b>6.312.945,33</b>	<b>0,069065665</b>
	Banca Comerciala Romana	Sold conturi in numele fondului	125.980,67	0,001378269
	BRD - Groupe Societe Generale SA	Sold conturi in numele fondului	6.155.596,19	0,067344214
	Citibank Romania	Sold conturi in numele fondului	9.694,14	0,000106057
	Garanti Bank SA	Sold conturi in numele fondului	21.407,21	0,000234202
	Raiffeisen Bank SA	Sold conturi in numele fondului	101,83	1,11405E-06
	Unicredit Bank SA	Sold conturi in numele fondului	165,29	1,80833E-06
b. Depozite în lei și valută convertibilă			<b>442.876.538,73</b>	<b>4,845212653</b>
	BRD - Groupe Societe Generale SA	Sold depozite in numele fondului	117.105.999,52	1,281177531
	Citibank Romania	Sold depozite in numele fondului	16.942.803,91	0,185359758
	Garanti Bank SA	Sold depozite in numele fondului	241.667.499,42	2,643920649
	Unicredit Bank SA	Sold depozite in numele fondului	67.160.235,88	0,734754714
c. Titluri de stat cu scadența mai mică de 1 an			<b>3.106.958,40</b>	<b>0,03399113</b>
	Ministerul Finantelor Publice	RO1516CTNOA1	3.106.958,40	0,03399113
<b>2. Valori mobiliare tranzacționate, din care:</b>			<b>8.276.036.249,88</b>	<b>90,54251478</b>
a. Titluri de stat cu scadența mai mare de 1 an			<b>5.955.456.541,72</b>	<b>65,15462181</b>
	Italia	IT0005083057	20.452.059,34	0,223752148
	Ministerul Finantelor Publice	RO0520DBNOL3	8.224.068,73	0,089973973
	Ministerul Finantelor Publice	RO0717DBN038	728.509.642,18	7,970131238
	Ministerul Finantelor Publice	RO1121DBN032	605.131.290,00	6,620332139
	Ministerul Finantelor Publice	RO1217DBN046	559.585.561,60	6,122047131
	Ministerul Finantelor Publice	RO1227DBN011	105.678.833,64	1,156160639
	Ministerul Finantelor Publice	RO1316DBN053	247.191.938,16	2,704359797
	Ministerul Finantelor Publice	RO1318DBN034	281.189.501,30	3,07630414
	Ministerul Finantelor Publice	RO1320DBN022	617.654.206,56	6,757336898
	Ministerul Finantelor Publice	RO1323DBN018	768.415.994,45	8,406719646
	Ministerul Finantelor Publice	RO1418DBN040	116.151.086,85	1,270730478
	Ministerul Finantelor Publice	RO1419DBE013	175.202.574,84	1,916772866
	Ministerul Finantelor Publice	RO1419DBN014	432.636.641,95	4,73184868
	Ministerul Finantelor Publice	RO1425DBN029	364.600.061,56	3,988842661
	Ministerul Finantelor Publice	RO1521DBN041	31.446.557,38	0,344035514
	Ministerul Finantelor Publice	US77586TAA43	71.419.542,03	0,781352902
	Ministerul Finantelor Publice	US77586TAE64	19.866.024,39	0,217340736
	Ministerul Finantelor Publice	XS0852474336	177.883.985,49	1,946108366
	Ministerul Finantelor Publice	XS0972758741	164.879.031,60	1,803829962
	Ministerul Finantelor Publice	XS1060842975	147.888.935,14	1,617952809
	Ministerul Finantelor Publice	XS1129788524	75.368.703,76	0,824558009
	Ministerul Finantelor Publice	XS1313004928	73.856.921,35	0,80801862
	Ministerul Finantelor Publice	XS1312891549	153.760.454,44	1,68218913
	Polonia	XS1209947271	8.462.924,98	0,092587138
b. Obligațiuni emise de administrația publică locală			<b>199.464.385,32</b>	<b>2,182204924</b>
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL012	76.435.610,93	0,836230319
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL020	57.258.907,10	0,626430973
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL038	32.007.894,02	0,350176719
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL046	32.886.639,34	0,359790477
	Timisoara - Romania	ROTIMYDBL037	875.333,93	0,009576436
c. Obligațiuni corporative tranzacționate			<b>361.634.792,01</b>	<b>3,956401653</b>
	Banca Comerciala Romana	XS0474834925	19.759.620,22	0,21617664
	Banca Comerciala Romana	XS0496326223	22.182.600,00	0,242684822
	Banca Comerciala Romana	XS0580557519	16.187.095,89	0,177092067
	DnB NOR Bank	XS0301678644	22.984.851,84	0,251461717
	Garanti Bank SA	ROGABRDBC011	30.915.760,52	0,338228425
	GDF Suez	ROGSEBDBC017	25.202.196,00	0,27572018
	JPMorgan Chase & Co	XS1190880465	45.434.666,82	0,497069958
	KBC Ifima NV	XS0446546367	3.355.062,66	0,036705471
	KFW	XS1242404330	64.342.733,59	0,703930327
	Lloyds TSB Bank PLC	XS0483065271	17.430.825,81	0,190698875
	Unicredit Bank Austria AG	XS1272229169	29.812.530,74	0,326158734
	Raiffeisen Bank SA	RORFZBDBC036	30.263.697,93	0,331094649
	Transelectrica SA	ROTSSEDBC013	18.036.275,33	0,197322689
	Unicredit Tiriac Bank SA	ROUCTBDBC014	15.726.874,66	0,172057098
d. Acțiuni			<b>1.716.667.830,12</b>	<b>18,78090159</b>
	Alumil ROM Industry	ROALUMACNOR8	1.279.078,92	0,013993537
	Andritz AG	AT0000730007	14.085.176,38	0,154096388
	AT S Austria Technologie Systemtechnik AG	AT0000969985	9.267.141,71	0,101385529
	Banca Comerciala Carpatica	ROBACRACNOR6	2.852.574,08	0,031208084
	Banca Transilvania SA	ROTLVAACNOR1	302.186.819,88	3,3060216
	Bank Polska Kasa Opieki	PLPEKAO00016	10.104.868,20	0,110550528

	BRD - Groupe Societe Generale SA	ROBRDBACNOR2	176.030.933,10	1,925835373
	Bursa de Valori Bucuresti SA	ROBVBAACNORO	15.164.982,00	0,165909811
	CEZ SA	CZ0005112300	7.267.286,25	0,079506463
	Compa SA	ROCMPSPACNOR9	11.264.606,53	0,123238441
	Concefa SA	ROCOFIACNOR7	-	0
	DO & CO AG	AT0000818802	6.757.793,20	0,073932444
	EFO Turism Hoteluri Restaurante Marea Neagra SA	ROEFRIACNOR6	644.039,04	0,007045996
	Electrica SA	ROELECACNOR5	144.340.713,20	1,579134112
	Erste Group Bank AG	AT0000652011	48.758.890,26	0,533438038
	Fondul Proprietatea SA	ROFPTAACNOR5	250.311.865,14	2,738492808
	Integerpl SA	PLINTEG00011	4.158.487,75	0,045495202
	Oil Terminal SA	ROOILTACNOR9	1.265.683,50	0,013846987
	OMV	AT0000743059	21.116.318,52	0,231019358
	OMV Petrom SA	ROSNPPACNOR9	172.815.725,84	1,890659965
	OTP Bank Nyrt	HU0000061726	7.673.675,40	0,083952492
	Pegas Nonwovens SA	LU0275164910	4.491.925,56	0,049143119
	PKP Cargo SA	PLPKPCR00011	1.706.080,05	0,018665068
	Polski Koncern Naftowy Orlen SA	PLPKN0000018	1.690.940,74	0,018499439
	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	PLPKO0000016	6.084.179,99	0,066562898
	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	PLPZU0000011	5.911.414,71	0,06467279
	Prodplast SA	ROPRLAACNOR7	55.487,16	0,000607047
	Richter Gedeon Nyrt	HU0000123096	4.115.661,39	0,045026667
	Romcarbon SA	ROROCEACNOR1	1.004.520,00	0,010989774
	Romgaz SA	ROSNGNACNOR3	160.145.548,80	1,752044128
	Ropharma SA	ROIAFRACNOR4	7.720.576,71	0,084465608
	SIF 1 Banat Crisana	ROSIFAACNOR2	11.170.983,13	0,12221417
	SIF 2 Moldova	ROSIFBACNOR0	1.996.440,00	0,0218417
	SIF 4 Muntenia	ROSIFDACNOR6	21.467.227,20	0,234858413
	SIF 5 Oltenia	ROSIFEACNOR4	33.199.896,21	0,363217608
	Teraplast SA	ROTRPLACNOR7	5.685.921,00	0,062205816
	Transelectrica SA	ROTSSELACNOR9	67.146.208,80	0,734601253
	Transgaz SA	ROTGNTACNOR8	108.480.679,00	1,186813734
	Voestalpine AG	AT0000937503	2.871.064,53	0,031410375
	Vrancart SA	ROVRJUACNOR7	5.071.403,52	0,055482796
	Wiener Staedische Versicherung AG	AT0000908504	9.390.712,91	0,102737438
	Work Service SA	PLWRKSR00019	2.498.328,89	0,027332527
	Zentiva SA	ROSCDBACNOR8	47.415.970,92	0,518746066
e. Obligațiuni BERD, BEI, BM			<b>42.812.700,71</b>	<b>0,4683848</b>
	European Bank for Reconstruction and Developmen	XS0411088353	5.760.183,23	0,063018269
	European Bank for Reconstruction and Developmen	XS0978719572	33.687.720,18	0,36855456
	European Investment Bank	XS0415604288	3.364.797,30	0,036811971
f. Alte obligațiuni emise de organisme străine neguvernamentale (investment grade)			-	-
<b>3. OPCVM</b>			<b>409.295.402,00</b>	<b>4,47782415</b>
	THEAM Quant Equity Europe Guru / BNP Paribas	FR0010730077	114.321.075,47	1,250709561
	db x - trackers Euro Stoxx 50 UCITS ETF / Deutsche E	LU0380865021	155.271.419,99	1,698719582
	ERSTE BOND FLEXIBLE RON/SAI ERSTE ASSET MANA	ROFDIN000010	136.675.903,62	1,495278615
	ERSTE EQUITY ROMANIA/SAI ERSTE ASSET MANAGE	ROFDIN0000G4	3.027.002,92	0,033116392
<b>4. Instrumente de acoperire a riscului, din care:</b>			<b>-</b>	<b>-0,010921925</b>
a. Futures			-	-
b. Options			-	-
c. Swaps			-	-
d. Forward			-	-
	Citibank Romania		998.318,26	-0,010921925
<b>5. Private equity</b>			-	-
<b>6. Alte instrumente financiare</b>			<b>3.867.669,13</b>	<b>0,042313552</b>