



Administrator de Fond	NN Asigurari de Viata SA
Cod administrator	SAA-RO-9112925
Fond de pensii	NN Optim
Cod fond	FP3-1069
Depozitar	BRD - Groupe Societe Generale SA
Cod depozitar	DEP-RO-373958

Structura portofoliului de investiții  
la data de 30.06.2017

Portofoliul de instrumente financiar	Denumire Emitent	ISIN / Denumire instrument	Valoare actualizata (lei)	Pondere in activul total al fondului (%)
<b>1. Instrumente ale pieței monetare, din care:</b>			<b>30,581,558.53</b>	<b>4.63</b>
a. Conturi curente				
	Banca Comerciala Romana	Sold conturi in numele fondului	272,880.19	0.04
	BRD - Groupe Societe Generale SA	Sold conturi in numele fondului	47.20	0.00
	Garanti Bank SA	Sold conturi in numele fondului	271,984.18	0.04
	ING Bank Romania	Sold conturi in numele fondului	406.49	0.00
	OTP Bank	Sold conturi in numele fondului	2.93	0.00
	Raiffeisen Bank SA	Sold conturi in numele fondului	229.39	0.00
	Unicredit Bank SA	Sold conturi in numele fondului	167.45	0.00
			42.55	0.00
b. Depozite în lei și valută convertibilă			30,308,678.34	4.58
	BRD - Groupe Societe Generale SA	Sold depozite in numele fondului	5,065,155.65	0.77
	Citibank Romania	Sold depozite in numele fondului	491,036.15	0.07
	Garanti Bank SA	Sold depozite in numele fondului	19,681,379.74	2.98
	ING Bank Romania	Sold depozite in numele fondului	71,000.79	0.01
	Unicredit Bank SA	Sold depozite in numele fondului	5,000,106.01	0.76
c. Titluri de stat cu scadența mai mică de 1 an			0.00	0.00
<b>2. Valori mobiliare tranzacționate, din care:</b>			<b>590,526,949.41</b>	<b>89.32</b>
a. Titluri de stat cu scadența mai mare de 1 an			402,796,773.18	60.92
	Ministerul Finantelor Publice	RO0520DBN0Y6	5,959,851.60	0.90
	Ministerul Finantelor Publice	RO1121DBN032	30,022,421.85	4.54
	Ministerul Finantelor Publice	RO1217DBN046	4,147,427.66	0.63
	Ministerul Finantelor Publice	RO1227DBN011	25,778,407.75	3.90
	Ministerul Finantelor Publice	RO1318DBN034	21,073,635.42	3.19
	Ministerul Finantelor Publice	RO1320DBN022	38,903,952.67	5.88
	Ministerul Finantelor Publice	RO1323DBN018	521,859.51	0.08
	Ministerul Finantelor Publice	RO1418DBN040	4,072,870.85	0.62
	Ministerul Finantelor Publice	RO1419DBE013	3,251,370.09	0.49
	Ministerul Finantelor Publice	RO1419DBN014	15,821,647.71	2.39
	Ministerul Finantelor Publice	RO1425DBN029	28,559,070.49	4.32
	Ministerul Finantelor Publice	RO1519DBN037	53,128,122.35	8.04
	Ministerul Finantelor Publice	RO1521DBN041	8,160,735.26	1.23
	Ministerul Finantelor Publice	RO1522DBN056	28,261,624.93	4.27
	Ministerul Finantelor Publice	RO1619DBN035	20,099,065.75	3.04
	Ministerul Finantelor Publice	RO1620DBN017	34,210,792.38	5.17
	Ministerul Finantelor Publice	RO1621DBE048	3,298,779.60	0.50
	Ministerul Finantelor Publice	RO1624DBN027	3,499,826.92	0.53
	Ministerul Finantelor Publice	RO1722DBN045	2,086,978.36	0.32
	Ministerul Finantelor Publice	XSO972758741	8,587,560.47	1.30
	Ministerul Finantelor Publice	XS1060842975	19,024,629.94	2.88
	Ministerul Finantelor Publice	XS1129788524	10,058,897.61	1.52
	Ministerul Finantelor Publice	XS1312891549	9,507,432.44	1.44
	Ministerul Finantelor Publice	XS1313004928	8,795,978.50	1.33
	Ministerul Finantelor Publice	XS1599193403	15,963,833.07	2.41
b. Obligațiuni emise de administrația publică locală			14,027,955.50	2.12
	Bacau - Romania	ROBACADBL033	2,305.83	0.00
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL012	4,459,132.99	0.67
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL020	4,294,116.82	0.65
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL038	2,075,798.90	0.31
	Bucuresti - Romania	ROPMBUDBL046	2,610,460.27	0.39
	Timisoara - Romania	ROTIMYDBL037	586,140.69	0.09
c. Obligațiuni corporative tranzacționate			52,259,759.12	7.90
	Garanti Bank SA	ROGABRDBC011	6,680,598.79	1.01
	Engie Romania SA	ROGSEDRBC017	3,527,832.00	0.53
	Raiffeisen Bank SA	RORFZBDBC036	2,335,982.58	0.35
	Unicredit Bank SA	ROUCTBDBC014	1,504,175.34	0.23
	Royal Bank of Scotland PLC	XS0460428328	2,440,882.19	0.37
	Banca Comerciala Romana	XS0474834925	623,619.32	0.09
	Lloyds TSB Bank PLC	XS0483065271	2,750,090.43	0.42
	Banca Comerciala Romana	XS0496326223	574,573.33	0.09
	JPMorgan Chase & Co	XS1190880465	1,586,456.51	0.24
	Unicredit Bank Austria AG	XS1272229169	3,072,780.82	0.46
	Intesa SanPaolo SpA	XS1372163888	9,578,360.68	1.45
	FCE Bank PLC	XS1412585165	2,006,213.70	0.30
	Leaseplan Corporation NV	XS1594594209	12,571,328.77	1.90
	Intesa SanPaolo SpA	XS1621779740	3,006,864.66	0.45
d. Acțiuni			114,470,322.57	17.31
	Erste Group Bank AG	AT0000652011	1,839,514.78	0.28
	DO & CO AG	AT0000818802	354,660.46	0.05
	Moneta Money Bank AS	CZ0008040318	1,247,848.81	0.19
	BRD - Groupe Societe Generale SA	ROBRDBACNOR2	13,610,082.00	2.06
	Bursa de Valori Bucuresti SA	ROBVBAACNOR0	490,303.80	0.07
	Compa SA	ROCMPSACNOR9	1,210,930.17	0.18
	Concefa SA	ROCOFIACNOR7	0.00	0.00
	Electrica SA	ROELECACNOR5	8,908,000.00	1.35
	Fondul Proprietatea SA	ROFFTAACNOR5	22,949,463.48	3.47
	Med Life SA	ROMEDLACNOR6	1,378,121.00	0.21
	Zentiva SA	ROSCDBACNOR8	2,344,198.50	0.35
	SIF 2 Moldova	ROSIFBACNOR0	72,525.00	0.01
	Romgaz SA	ROSGNGACNOR3	12,546,123.00	1.90
	OMV Petrom SA	ROSNPPACNOR9	13,412,553.97	2.03
	Transgaz SA	ROTGNTACNOR8	8,337,462.00	1.26
	Banca Transilvania SA	ROTLVAACNOR1	21,156,645.45	3.20
	Teraplast SA	ROTRPLACNOR7	855,559.13	0.13
	Transselectrica SA	ROTSELACNOR9	2,841,227.40	0.43
	Vrancart SA	ROVRUIACNOR7	915,103.62	0.14
e. Obligațiuni BERD, BEI, BM			0.00	0.00
f. Alte obligațiuni emise de organisme străine neguvernamentale (investment grade)			0.00	0.00
	International Investment Bank	ROIIBKDBC023	6,972,139.04	1.05
			6,972,139.04	1.05
<b>3. OPCVM</b>			<b>28,775,936.35</b>	<b>4.35</b>
	db x - trackers Euro Stoxx 50 UCITS ETF / db x	LU0380865021	25,611,160.92	3.87
	THEAM Quant Equity Europe Guru / Theam	LU1235105779	3,164,775.43	0.48
<b>4. Instrumente de acoperire a riscului, din care:</b>			<b>158,892.28</b>	<b>0.02</b>
a. Futures			0.00	0.00
b. Options			0.00	0.00
c. Swaps			0.00	0.00
d. Forward			0.00	0.00
	Citibank Romania		158,892.28	0.02
	ING Bank Romania		-77,987.59	-0.01
			236,879.87	0.04
<b>5. Private equity</b>			<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>6. Alte instrumente financiare</b>			<b>11,113,567.41</b>	<b>1.68</b>