



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

**Structura portofoliului de investiții
la data de 30.09.2023**

| Portofolii de instrumente financiare | Denumire Emitent | ISIN / Denumire instrument | Valoare actualizata (lei) | Pondere in activul total al fondului (%) |
|--|----------------------------------|----------------------------------|---------------------------|--|
| 1. Instrumente ale pieței monetare, din care: | | | 68,782,054.15 | 3.59 |
| a. Conturi curente | | | 1,784.94 | 0.00 |
| | Banca Comerciala Romana | Sold conturi in numele fondului | 135.46 | 0.00 |
| | BRD - Groupe Societe Generale SA | Sold conturi in numele fondului | 642.52 | 0.00 |
| | CEC Bank SA | Sold conturi in numele fondului | 45.72 | 0.00 |
| | Citibank Romania | Sold conturi in numele fondului | 645.18 | 0.00 |
| | ING Bank Romania | Sold conturi in numele fondului | 218.65 | 0.00 |
| | Unicredit Bank SA | Sold conturi in numele fondului | 97.41 | 0.00 |
| b. Depozite în lei și valută convertibilă | | | 68,780,269.21 | 3.59 |
| | BRD - Groupe Societe Generale SA | Sold depozite in numele fondului | 18,764,019.21 | 0.98 |
| | Citibank Romania | Sold depozite in numele fondului | 50,016,250.00 | 2.61 |
| c. Titluri de stat cu scadența mai mică de 1 an | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| 2. Valori mobiliare tranzacționate, din care: | | | 1,822,814,148.78 | 95.05 |
| a. Titluri de stat cu scadența mai mare de 1 an | | | 1,283,485,042.84 | 66.93 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROODU3PR9NF9 | 81,306,798.79 | 4.24 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO0TLVC1MCW4 | 40,169,731.51 | 2.09 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1227DBN011 | 24,809,627.21 | 1.29 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1425DBN029 | 10,689,038.55 | 0.56 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1624DBN027 | 32,106,776.60 | 1.67 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1631DBN055 | 75,269,853.46 | 3.93 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1J9H39WKT4 | 24,212,507.99 | 1.26 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1JS63DR5A5 | 39,756,416.46 | 2.07 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO3B41D8EX14 | 65,521,527.49 | 3.42 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO4KELYFLVK4 | 43,396,453.26 | 2.26 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO52CQA3C829 | 76,958,329.18 | 4.01 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO7P95F9FNY6 | 41,818,414.38 | 2.18 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROAW5KY5CD78 | 30,927,057.53 | 1.61 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RODD24CXRK47 | 24,064,312.84 | 1.25 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROGSHSTVFMX2 | 59,131,338.80 | 3.08 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROGV3LGNPCW9 | 59,536,880.25 | 3.10 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROHRVN7NLN02 | 88,951,802.83 | 4.64 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROINPAL298G4 | 61,193,874.45 | 3.19 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROJEC97WMUQ4 | 5,013,612.13 | 0.26 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROO7A2H5YIN8 | 24,966,550.48 | 1.30 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROP9QVD42HO2 | 7,288,890.00 | 0.38 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROVRZSEM43E4 | 71,475,065.27 | 3.73 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROWLVEJ2A207 | 37,172,445.62 | 1.94 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROXL7LT7QZ66 | 50,525,449.54 | 2.63 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROZBOC49U096 | 47,905,226.63 | 2.50 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS1599193403 | 5,965,769.44 | 0.31 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS1892141620 | 6,650,303.39 | 0.35 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS1934867547 | 4,618,637.39 | 0.24 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS1968706876 | 6,650,363.50 | 0.35 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS1970549561 | 1,961,581.15 | 0.10 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2109812508 | 8,564,665.41 | 0.45 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2178857954 | 4,777,513.85 | 0.25 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2258400162 | 4,559,378.32 | 0.24 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2330503694 | 5,548,466.81 | 0.29 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2330514899 | 5,936,037.46 | 0.31 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2364200514 | 7,191,031.56 | 0.37 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2434895806 | 40,035,900.98 | 2.09 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2538441598 | 33,238,791.21 | 1.73 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2689948078 | 13,741,318.50 | 0.72 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2689949399 | 9,877,302.62 | 0.52 |
| b. Obligațiuni emise de administrația publică locală | | | 10,567,297.87 | 0.55 |
| | Bacau - Romania | ROBACADBL033 | 793.66 | 0.00 |
| | Bucuresti - Romania | RODPCQ8K7R09 | 4,881,720.49 | 0.25 |
| | Bucuresti - Romania | ROPMBUDBL046 | 2,477,254.10 | 0.13 |
| | Timisoara - Romania | ROTIMYDBL037 | 265,717.22 | 0.01 |

| | | | | |
|---|--|------------------------------|-------------------------------|--------------|
| | Bucuresti - Romania | ROZH3OWXL435 | 2,941,812.40 | 0.15 |
| c. Obligațiuni corporative tranzacționate | | | 65,321,018.03 | 3.41 |
| | Banca Comerciala Romana | AT0000A34CN3 | 5,269,270.43 | 0.27 |
| | Banca Comerciala Romana | RO1AQREPLMW7 | 8,113,377.05 | 0.42 |
| | Banca Comerciala Romana | RO451CMZH2K1 | 5,169,923.50 | 0.27 |
| | Banca Comerciala Romana | ROP9F84ZSG4 | 5,135,192.76 | 0.27 |
| | Banca Comerciala Romana | ROPQT4NGMLM3 | 9,436,458.08 | 0.49 |
| | JPMorgan Chase & Co | XS1190880465 | 1,511,207.09 | 0.08 |
| | Leaseplan Corporation NV | XS1696658001 | 7,641,138.63 | 0.40 |
| | Citigroup Global Markets Holdings Inc | XS1762726278 | 4,037,858.38 | 0.21 |
| | Banco Santander SA | XS2401160226 | 10,454,575.34 | 0.55 |
| | Banca Transilvania SA | XS2616733981 | 8,552,016.77 | 0.45 |
| d. Acțiuni | | | 463,440,790.04 | 24.17 |
| | Eurofins Scientific SE | FR0014000MR3 | 5,229,672.62 | 0.27 |
| | Enel SpA | IT0003128367 | 5,262,057.26 | 0.27 |
| | Digi Communications NV | NL0012294474 | 9,921,684.80 | 0.52 |
| | Hydroelectrica SA | RO4Q0Z5RO1B6 | 71,044,200.00 | 3.70 |
| | Aquila Part Prod Com SA | RO7066ZEA1R9 | 9,491,266.87 | 0.49 |
| | Alro SA | ROALROACNOR0 | 3,187,750.00 | 0.17 |
| | BRD - Groupe Societe Generale SA | ROBRDBACNOR2 | 25,805,208.44 | 1.35 |
| | Bursa de Valori Bucuresti SA | ROBVBAACNOR0 | 986,605.20 | 0.05 |
| | Compa SA | ROCMPSACNOR9 | 541,597.46 | 0.03 |
| | Electrica SA | ROLECACNOR5 | 14,877,169.48 | 0.78 |
| | Fondul Proprietatea SA | ROFPTAACNOR5 | 13,516,951.56 | 0.70 |
| | Med Life SA | ROMEDLACNOR6 | 26,694,395.00 | 1.39 |
| | Sphera Franchise Group SA | ROSFPGACNOR4 | 8,697,477.60 | 0.45 |
| | Romgaz SA | ROSNNGACNOR3 | 53,213,940.00 | 2.77 |
| | Nuclearelectrica SA | ROSNNEACNOR8 | 24,546,400.00 | 1.28 |
| | OMV Petrom SA | ROSNPPACNOR9 | 89,125,768.29 | 4.65 |
| | Transgaz SA | ROTGNTACNOR8 | 19,580,293.76 | 1.02 |
| | Banca Transilvania SA | ROTLVAACNOR1 | 66,298,364.60 | 3.46 |
| | Transport Trade Services SA | ROYCRRK66RD8 | 15,419,987.10 | 0.80 |
| e. Obligațiuni BERD, BEI, BM | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| f. Alte obligațiuni emise de organisme străine neguvernamentale (investment grade) | | | 0.00 | 0.00 |
| | International Investment Bank | XS2400041864 | 0.00 | 0.00 |
| 3. OPCVM | | | 22,966,999.50 | 1.20 |
| | iShares S&P 500 Information Technology Sector UCITS ETF USD (Acc) / BlackRock Inc | IE00B3WJKG14 | 5,685,221.61 | 0.30 |
| | Xtrackers Euro Stoxx 50 UCITS ETF 1C / Xtrackers BNP Paribas Funds Energy Transition / BNP Paribas Asset Management Luxembourg | LU0380865021 LU0823414809 | 14,392,910.69 2,888,867.20 | 0.75 0.15 |
| 4. Instrumente de acoperire a riscului, din care: | | | 506,324.35 | 0.03 |
| a. Futures | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| b. Options | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| c. Swaps | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| d. Forward | | | 506,324.35 | 0.03 |
| | Erste Group Bank AG | | 98,533.85 | 0.01 |
| | ING Bank Romania | | 407,790.50 | 0.02 |
| 5. Private equity, din care: | | | 0.00 | 0.00 |
| a. Acțiuni la societăți | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| b. Participanții la fonduri de investiții private de capital | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| c. Obligațiuni | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| 6. Real estate, din care: | | | 0.00 | 0.00 |
| a. Valori mobiliare emise de societăți | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| b. Valori mobiliare emise de fonduri | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| 7. Investiții în infrastructură, din care: | | | 0.00 | 0.00 |
| a. Acțiuni și obligațiuni emise de societăți de proiect | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| b. Fonduri de investiții specializate în infrastructură | | | 0.00 | 0.00 |
| | | | 0.00 | 0.00 |
| 8. Alte instrumente financiare * | | | 2,578,455.13 | 0.13 |

* include sume nete de plata/incasare pentru tranzactii in curs de decontare, dividende de incasat