



| | |
|------------------------------|----------------------------------|
| 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 31.08.2023**

| 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: | | | 8,236,273.41 | 0.44 |
| a. Conturi curente | | | 1,842.05 | 0.00 |
| | Banca Comerciala Romana | Sold conturi in numele fondului | 155.46 | 0.00 |
| | BRD - Groupe Societe Generale SA | Sold conturi in numele fondului | 624.92 | 0.00 |
| | CEC Bank SA | Sold conturi in numele fondului | 45.72 | 0.00 |
| | Citibank Romania | Sold conturi in numele fondului | 642.44 | 0.00 |
| | ING Bank Romania | Sold conturi in numele fondului | 218.65 | 0.00 |
| | Unicredit Bank SA | Sold conturi in numele fondului | 154.86 | 0.00 |
| b. Depozite în lei și valută convertibilă | | | 8,234,431.36 | 0.44 |
| | BRD - Groupe Societe Generale SA | Sold depozite in numele fondului | 8,234,431.36 | 0.44 |
| 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: | | | 1,840,807,433.09 | 98.27 |
| a. Titluri de stat cu scadența mai mare de 1 an | | | 1,279,970,778.61 | 68.33 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO0DU3PR9NF9 | 82,251,149.86 | 4.39 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO0TLVC1MCW4 | 39,982,087.67 | 2.13 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1227DBN011 | 24,795,159.93 | 1.32 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1425DBN029 | 10,640,446.99 | 0.57 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1624DBN027 | 45,837,372.92 | 2.45 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1631DBN055 | 79,038,531.00 | 4.22 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1J9H39WKT4 | 24,693,634.59 | 1.32 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO1JS63DR5A5 | 40,128,194.95 | 2.14 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO3B41D8EX14 | 65,834,253.39 | 3.51 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO4KELYFLVK4 | 43,895,721.42 | 2.34 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO52CQA3C829 | 83,552,146.63 | 4.46 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RO7P95F9FNY6 | 41,962,111.64 | 2.24 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROAW5KY5CD78 | 31,029,325.89 | 1.66 |
| | Ministerul Finantelor Publice | RODD24CXRX47 | 23,964,267.76 | 1.28 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROGSHSTVFMX2 | 58,939,953.96 | 3.15 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROGV3LGNPCW9 | 59,270,408.03 | 3.16 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROHRVN7NLNO2 | 88,556,392.35 | 4.73 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROINPAL298G4 | 61,547,953.77 | 3.29 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROJEC97WMUQ4 | 4,989,375.00 | 0.27 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROO7A2H5YIN8 | 25,303,257.67 | 1.35 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROVRZSEM43E4 | 71,653,895.89 | 3.83 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROWLVEJ2A207 | 31,487,457.12 | 1.68 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROXL7LT7QZ66 | 42,148,022.27 | 2.25 |
| | Ministerul Finantelor Publice | ROZBOC49U096 | 48,235,577.26 | 2.58 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS1599193403 | 16,076,173.75 | 0.86 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS1892141620 | 6,630,729.94 | 0.35 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS1934867547 | 4,609,201.45 | 0.25 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS1968706876 | 7,003,470.34 | 0.37 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS1970549561 | 2,001,803.38 | 0.11 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2109812508 | 8,725,070.65 | 0.47 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2178857954 | 4,836,584.75 | 0.26 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2258400162 | 4,700,441.72 | 0.25 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2330503694 | 5,688,627.84 | 0.30 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2330514899 | 6,166,360.24 | 0.33 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2364200514 | 7,446,378.36 | 0.40 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2434895806 | 40,833,348.59 | 2.18 |
| | Ministerul Finantelor Publice | XS2538441598 | 35,515,889.64 | 1.90 |
| b. Obligațiuni emise de administrația publică locală | | | 10,497,470.83 | 0.56 |
| | Bacau - Romania | ROBACADBL033 | 788.67 | 0.00 |
| | Bucuresti - Romania | RODPCQ8K7RO9 | 4,847,433.61 | 0.26 |
| | Bucuresti - Romania | ROPMBUDBL046 | 2,459,053.28 | 0.13 |
| | Timisoara - Romania | ROTIMYDBL037 | 266,828.03 | 0.01 |
| | Bucuresti - Romania | ROZH3OWXL435 | 2,923,367.24 | 0.16 |
| c. Obligațiuni corporative tranzacționate | | | 64,995,217.16 | 3.47 |
| | Banca Comerciala Romana | AT0000A34CN3 | 5,269,616.86 | 0.28 |
| | Banca Comerciala Romana | RO1AQREPLMW7 | 8,087,803.28 | 0.43 |

| | | | | |
|--|---|---------------|----------------|-------|
| | Banca Comerciala Romana | RO451CMZH2K1 | 5,142,218.58 | 0.27 |
| | Banca Comerciala Romana | ROPC9F84ZSG4 | 5,097,983.74 | 0.27 |
| | Banca Comerciala Romana | ROPQT4NGMLM3 | 9,392,222.47 | 0.50 |
| | JPMorgan Chase & Co | XS1190880465 | 1,506,135.37 | 0.08 |
| | Leaseplan Corporation NV | XS1696658001 | 7,614,508.49 | 0.41 |
| | Citigroup Global Markets Holdings Inc | XS1762726278 | 4,021,792.81 | 0.21 |
| | Banco Santander SA | XS2401160226 | 10,414,465.75 | 0.56 |
| | Banca Transilvania SA | XS2616733981 | 8,448,469.81 | 0.45 |
| d. Acțiuni | | | 485,343,966.49 | 25.91 |
| | Eurofins Scientific SE | FR0014000MR3 | 5,518,855.93 | 0.29 |
| | Enel SpA | IT0003128367 | 5,576,971.85 | 0.30 |
| | Digi Communications NV | NL0012294474 | 8,300,290.50 | 0.44 |
| | Hidroelectrica SA | RO4Q0Z5RO1B6 | 66,899,955.00 | 3.57 |
| | Aquila Part Prod Com SA | RO7066ZEA1R9 | 9,386,506.75 | 0.50 |
| | Alro SA | ROALROACNOR0 | 3,218,500.00 | 0.17 |
| | BRD - Groupe Societe Generale SA | ROBRDBACNOR2 | 24,252,270.16 | 1.29 |
| | Bursa de Valori Bucuresti SA | ROBVBAACNOR0 | 788,684.40 | 0.04 |
| | Compa SA | ROCMPSACNOR9 | 535,466.17 | 0.03 |
| | Electrica SA | ROELECACNOR5 | 14,261,666.00 | 0.76 |
| | Fondul Proprietatea SA | ROFPTAACNOR5 | 62,628,542.23 | 3.34 |
| | Med Life SA | ROMEDLACNOR6 | 27,193,081.50 | 1.45 |
| | Sphera Franchise Group SA | ROSFPGPACNOR4 | 8,277,309.60 | 0.44 |
| | Romgaz SA | ROSGNACNOR3 | 47,892,546.00 | 2.56 |
| | Nuclearelectrica SA | ROSNNEACNOR8 | 23,666,150.00 | 1.26 |
| | OMV Petrom SA | ROSNPPACNOR9 | 83,184,050.40 | 4.44 |
| | Transgaz SA | ROTGNTACNOR8 | 16,964,137.60 | 0.91 |
| | Banca Transilvania SA | ROTLVAACNOR1 | 62,998,446.00 | 3.36 |
| | Transport Trade Services SA | ROYCRRK66RD8 | 13,800,536.40 | 0.74 |
| 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 | | | 23,899,803.10 | 1.28 |
| | iShares S&P 500 Information Technology Sector UCITS ETF USD (Acc) / BlackRock Inc | IE00B3WJKG14 | 5,899,125.74 | 0.31 |
| | Xtrackers Euro Stoxx 50 UCITS ETF 1C / Xtrackers | LU0380865021 | 14,715,894.19 | 0.79 |
| | BNP Paribas Funds Energy Transition / BNP Paribas Asset Management Luxembourg | LU0823414809 | 3,284,783.17 | 0.18 |
| 4. Instrumente de acoperire a riscului, din care: | | | 769,084.63 | 0.04 |
| 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 | | | 769,084.63 | 0.04 |
| | Erste Group Bank AG | | 102,583.60 | 0.01 |
| | ING Bank Romania | | 666,501.03 | 0.04 |
| 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 | | | -577,718.97 | -0.03 |

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