

Structura portofoliului de investiții la data de 31.08.2022

| Portofoliul de instrumente financiare                                                     | Denumire emitent                                    | ISIN          | Valoare actualizată (lei) | Pondere în total active (%) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|
| Col 1                                                                                     | Col 2                                               | Col 3         | Col 4                     | Col 5                       |
| <b>1. Instrumente ale pieței monetare, din care:</b>                                      |                                                     |               | <b>512,198.48</b>         | <b>4.556%</b>               |
| <b>a) Conturi curente</b>                                                                 |                                                     |               | <b>54,296.81</b>          | <b>0.483%</b>               |
|                                                                                           | BRD - Groupe Societe Generale SA                    |               | 10,540.24                 | 0.094%                      |
|                                                                                           | BRD - Groupe Societe Generale SA                    |               | 43,756.57                 | 0.389%                      |
| <b>b) Depozite în lei și valută convertibilă</b>                                          |                                                     |               | <b>457,901.67</b>         | <b>4.073%</b>               |
|                                                                                           | BRD - Groupe Societe Generale SA                    |               | 174,587.36                | 1.553%                      |
|                                                                                           | Citibank Romania                                    |               | 283,314.31                | 2.520%                      |
| <b>c) Titluri de stat cu scadența mai mică de 1 an</b>                                    |                                                     |               | -                         | <b>0.000%</b>               |
| <b>2. Valori mobiliare tranzacționate, din care:</b>                                      |                                                     |               | <b>10,597,416.68</b>      | <b>94.255%</b>              |
| <b>a) Titluri de stat cu scadența mai mare de 1 an</b>                                    |                                                     |               | <b>7,381,234.71</b>       | <b>65.650%</b>              |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RO0TLVC1MCW4  | 284,934.66                | 2.534%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RO1227DBN011  | 462,815.27                | 4.116%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RO1425DBN029  | 341,022.14                | 3.033%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RO1624DBN027  | 407,292.17                | 3.623%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RO1631DBN055  | 176,713.60                | 1.572%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RO1823DBN025  | 560,282.67                | 4.983%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RO1J9H39WKT4  | 114,037.57                | 1.014%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RO3B41D8EX14  | 186,513.02                | 1.659%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RO4KELYFLVK4  | 642,635.03                | 5.716%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RO7P95F9FNY6  | 72,185.66                 | 0.642%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | ROAW5KY5CD78  | 342,517.38                | 3.046%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | ROD9T7E7MEES0 | 404,210.52                | 3.595%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | RODD24CXRK47  | 409,236.10                | 3.640%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | ROGSHT5TFVMX2 | 812,543.88                | 7.227%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | ROGV3LGNPCW9  | 398,186.93                | 3.542%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | ROHRVN7NLNO2  | 579,266.78                | 5.152%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | ROINPAL298G4  | 311,189.70                | 2.768%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | ROJ0LNOCKHR8  | 81,827.41                 | 0.728%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | ROJEC97WUQ4   | 318,957.63                | 2.837%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | ROVRZSEM43E4  | 377,288.34                | 3.356%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | XS1312891549  | 53,247.37                 | 0.474%                      |
|                                                                                           | Ministerul Finantelor Publice                       | XS1599193403  | 44,330.88                 | 0.394%                      |
| <b>b) Obligațiuni emise de administrația publică locală</b>                               |                                                     |               | -                         | <b>0.000%</b>               |
| <b>c) Obligațiuni corporative tranzacționate</b>                                          |                                                     |               | <b>404,760.22</b>         | <b>3.600%</b>               |
|                                                                                           | Citigroup Inc                                       | XS2110112625  | 404,760.22                | 3.600%                      |
| <b>d) Acțiuni</b>                                                                         |                                                     |               | <b>2,811,421.75</b>       | <b>25.005%</b>              |
|                                                                                           | Aquila Part Prod Com SA                             | RO7066ZEA1R9  | 38,760.00                 | 0.345%                      |
|                                                                                           | Axa SA                                              | FR0000120628  | 21,725.22                 | 0.193%                      |
|                                                                                           | Banca Transilvania SA                               | ROTLVACNOR1   | 356,986.10                | 3.175%                      |
|                                                                                           | BRD - Groupe Societe Generale SA                    | ROBRDBACNOR2  | 200,100.00                | 1.780%                      |
|                                                                                           | Bursa de Valori Bucuresti SA                        | ROBVBAACNOR0  | 23,322.00                 | 0.207%                      |
|                                                                                           | Commerzbank AG                                      | DE000CBK1001  | 12,245.54                 | 0.109%                      |
|                                                                                           | Compa SA                                            | ROCMP5ACNOR9  | 16,596.00                 | 0.148%                      |
|                                                                                           | Compet SA                                           | ROCOTEACNOR7  | 13,400.00                 | 0.119%                      |
|                                                                                           | Covestro AG                                         | DE0006062144  | 8,491.10                  | 0.076%                      |
|                                                                                           | Deutsche Post AG                                    | DE0005552004  | 23,881.22                 | 0.212%                      |
|                                                                                           | Digi Communications NV                              | NL0012294474  | 73,600.00                 | 0.655%                      |
|                                                                                           | Electrica SA                                        | ROELECACNOR5  | 79,000.00                 | 0.703%                      |
|                                                                                           | Evergent Investments SA                             | ROSIFBACNOR0  | 63,250.00                 | 0.563%                      |
|                                                                                           | Fondul Proprietatea SA                              | ROFPTAACNOR5  | 400,980.00                | 3.566%                      |
|                                                                                           | Koninklijke Philips NV                              | NL0000009538  | 13,594.16                 | 0.121%                      |
|                                                                                           | Med Life SA                                         | ROMEDLACNOR6  | 104,720.00                | 0.931%                      |
|                                                                                           | Nuclearelectrica SA                                 | ROSNNACNOR8   | 336,375.00                | 2.992%                      |
|                                                                                           | OMV Petrom SA                                       | ROSNPPACNOR9  | 417,120.00                | 3.710%                      |
|                                                                                           | Romgaz SA                                           | ROSNNGACNOR3  | 281,610.00                | 2.505%                      |
|                                                                                           | Siemens AG                                          | DE0007236101  | 24,564.97                 | 0.218%                      |
|                                                                                           | Siemens Energy AG                                   | DE000ENER6Y0  | 1,783.20                  | 0.016%                      |
|                                                                                           | SIF 4 Muntenia                                      | ROSIFDACNOR6  | 42,600.00                 | 0.379%                      |
|                                                                                           | SIF 5 Oltenia                                       | ROSIFEACNOR4  | 8,814.10                  | 0.078%                      |
|                                                                                           | Teraplast SA                                        | ROTRPLACNOR7  | 38,350.00                 | 0.341%                      |
|                                                                                           | Transelectrica SA                                   | ROTELEACNOR9  | 36,200.00                 | 0.322%                      |
|                                                                                           | Transgaz SA                                         | ROTGNTACNOR8  | 70,200.00                 | 0.624%                      |
|                                                                                           | Transilvania Investments Alliance SA                | ROSIFCACNOR8  | 43,088.76                 | 0.383%                      |
|                                                                                           | Transport Trade Services SA                         | ROYCRRK66RD8  | 50,200.00                 | 0.446%                      |
|                                                                                           | United Internet AG                                  | DE0005089031  | 9,864.38                  | 0.088%                      |
| <b>e) Obligațiuni BERD, BEI, BM</b>                                                       |                                                     |               | -                         | <b>0.000%</b>               |
| <b>f) Alte obligațiuni emise de organisme străine neguvernamentale (investment grade)</b> |                                                     |               | -                         | <b>0.000%</b>               |
| <b>3. OPCVM</b>                                                                           |                                                     |               | <b>94,167.33</b>          | <b>0.838%</b>               |
|                                                                                           | Xtrackers Stoxx Europe 600 UCITS ETF 1C / Xtrackers | LU0328475792  | 94,167.33                 | 0.838%                      |
| <b>4. Instrumente de acoperire a riscului, din care:*</b>                                 |                                                     |               | -                         | <b>0.000%</b>               |
| <b>a) Futures</b>                                                                         |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>b) Options</b>                                                                         |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>c) Swaps</b>                                                                           |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>d) Forward</b>                                                                         |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>5. Private equity, din care:</b>                                                       |                                                     |               | -                         | <b>0.000%</b>               |
| <b>a) Acțiuni la societăți</b>                                                            |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>b) Participații la fonduri de investiții private de capital</b>                        |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>c) Obligațiuni</b>                                                                     |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>6. Real estate, din care:</b>                                                          |                                                     |               | -                         | <b>0.000%</b>               |
| <b>a) Valori mobiliare emise de societăți</b>                                             |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>b) Valori mobiliare emise de fonduri</b>                                               |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>7. Investiții în infrastructură, din care:</b>                                         |                                                     |               | -                         | <b>0.000%</b>               |
| <b>a) Acțiuni și obligațiuni emise de societăți de proiect</b>                            |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>b) Fonduri de investiții specializate în infrastructură</b>                            |                                                     |               | -                         | 0.000%                      |
| <b>8. Alte instrumente financiare</b>                                                     |                                                     |               | <b>39,600.00</b>          | <b>0.352%</b>               |
| <b>a) Dividende de încasat</b>                                                            |                                                     |               | <b>39,600.00</b>          | <b>0.352%</b>               |
|                                                                                           | OMV Petrom SA                                       | ROSNPPACNOR9  | 39,600.00                 | 0.352%                      |
| <b>b) Drepturi</b>                                                                        |                                                     |               | -                         | <b>0.000%</b>               |
|                                                                                           | OMV Petrom SA                                       | RO52R88LRB29  | -                         | 0.000%                      |

\* În aceste categorii sunt incluse și valorile aferente marjelor constituite pentru contractele derivate, după caz.