

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 31/12/2019



## Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluście wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające	
PKO034	Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020	SFIO	N/D	PLN	OBLIGACJI DŁUGOTERMINOWYCH	AIO992351913	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	648 212	158 714 750	10,72%		
		SFIO	N/D	PLN	PAPIEROW DŁUŻNYCH PLUS SKARBOWY	AIO992351923	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	719 094	140 942 415	9,52%		
		SFIO	N/D	PLN			AIO992351905	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	35 291	83 199 416	5,62%	
		SFIO	N/D	PLN				N/D	FX Swap	N/D		EUR/PLN		-27 613	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN				N/D	FX Swap	N/D		USD/PLN		68 149	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN				N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		USD		40 236	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN				N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		USD		15 133	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN				N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		EUR		3 059 704	0,21%	
		SFIO	N/D	PLN				N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		PLN		43 188 100	2,92%	
		SFIO	N/D	PLN				N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		EUR		73 689	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN				N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		PLN		7 559 019	0,51%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000108866	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	78 700	82 050 259	5,54%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000109427	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	48 800	50 774 936	3,43%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000108916	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	20 000	20 436 600	1,38%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000111720	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	43 000	44 036 300	2,97%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000107264	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	60 000	65 493 000	4,42%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000109492	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	135 300	139 526 139	9,43%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000112165	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	40 039	38 461 463	2,60%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000107611	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	1 000	1 067 210	0,07%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000110151	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	138 000	144 691 620	9,77%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000110383	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN		0	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000111928	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN		0	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000108510	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	1 956	1 980 000	0,13%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000105391	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	10 000	13 625 500	0,92%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000108197	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	72 000	78 025 680	5,27%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000111498	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	80 000	84 900 800	5,74%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000111274	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	175 000	171 605 000	11,59%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000111191	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	102 000	106 822 560	7,22%	

## Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluście wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające
PKO035	Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020	SFIO	N/D	PLN	ALIOR BANK SA	PLALIOR000045	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	11 771	237 592	0,09%	
		SFIO	N/D	PLN	BANK MILLENNIUM	PLBIG0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	19 906	116 450	0,03%	
		SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKA000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	22 446	2 254 701	0,60%	
		SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCC000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	6 049	665 390	0,18%	
		SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLOPTC00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	8 143	2 275 968	0,60%	
		SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	18 963	529 826	0,14%	
		SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 229	176 976	0,05%	
		SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLENEA000013	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	12 262	97 054	0,03%	
		SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG00022	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	21 608	152 985	0,04%	
		SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTCTC000037	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	7 208	69 773	0,02%	
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 885	55 193	0,01%	
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLLOTOS00025	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	10 784	901 327	0,24%	
		SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK0000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	972	196 830	0,05%	
		SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	7 012	149 917	0,04%	
		SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU0327357389	N/D	Akcje	N/D	UA	PLN	1 757	79 504	0,02%	
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM0000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	28 937	2 765 798	0,73%	
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	174	1 534 680	0,41%	
		SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE0000012	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 743	678 724	0,18%	
		SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL00017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	86 426	615 353	0,16%	
		SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER000010	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	113 781	905 697	0,24%	
		SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 190	24 395	0,01%	
		SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU1642887738	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	38 009	1 330 315	0,35%	
		SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKN0000018	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	34 165	2 932 040	0,77%	
		SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICZTWO NAFTOWE I GA	PLPGN0000014	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	218 676	946 430	0,25%	
		SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	97 944	3 375 150	0,89%	
		SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	86 865	3 477 206	0,92%	
		SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLBZ0000044	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	4 727	1 453 080	0,38%	
		SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURN00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	892 104	1 463 051	0,39%	
		SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKRUSZ00016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	22 380	1 092 144	0,29%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH	AIO992351941	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	2 702	305 846	0,08%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AIO992351940	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	35 840	4 002 267	1,06%	
		SFIO	N/D	PLN	OBLIGACJI DŁUGOTERMINOWYCH	AIO992351913	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	121 374	29 718 421	7,85%	
		SFIO	N/D	PLN	PAPIEROW DŁUŻNYCH PLUS	AIO992351923	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	110 611	21 679 759	5,73%	
		SFIO	N/D	PLN	SKARBOWY	AIO992351905	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	242	569 989	0,15%	
		SFIO	N/D	PLN	STABILNEGO WZROSTU	AIO992351902	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	664	115 650	0,03%	
		SFIO	N/D	PLN	DB X-TRACKERS DAX UCITS ETF (DR)	LU0274211480	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	DE	EUR	1 332	724 809	0,19%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	US	USD	8 577	10 528 855	2,78%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	US	USD	5 429 715	1 433	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD	IE0031442068	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	IE	USD	88 963	10 838 382	2,86%	
		SFIO	N/D	PLN	PL WSE F		N/D	Kontrakt terminowy	N/D	PL	PLN		1 806 152	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN	US CMIE E		N/D	Kontrakt terminowy	N/D	US	USD		-9 287 880	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D		USD/PLN		2 077 846	0,55%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D		JPY/PLN		9 267	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D		EUR/PLN		87 616	0,02%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Spot-Forward	N/D		EUR/PLN		-38	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		USD		51 219 465	13,53%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		JPY		350	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		EUR		7 140 893	1,89%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		PLN		15 914 237	4,20%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		EUR		4 036 891	1,07%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		USD		249 917	0,07%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000107611	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	8 500	9 071 285	2,40%
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000109492	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	24 700	25 461 995	6,73%		
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000108866	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	10 000	10 425 700	2,75%		
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000111191	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	21 000	21 992 880	5,81%		
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000111720	N/D	Obligacje	N/D	PL	PLN	16 000	16 385 600	4,33%		

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 31/12/2019



Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluście wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109427	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		17 000	17 687 990	4,67%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL000011274	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		32 000	31 379 200	8,23%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110383	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		0	0	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107264	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		8 000	8 732 400	2,31%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108197	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		9 000	9 753 210	2,58%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110151	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		28 300	29 672 267	7,84%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111498	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		2 500	2 653 150	0,70%	

## Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluście wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające
SFIO	N/D	PLN	ALIOR BANK SA	PLALIOR000045	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		17 076	489 740	0,23%	
SFIO	N/D	PLN	BANK MILLENNIUM	PLBIG0000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		32 042	187 446	0,09%	
SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKA000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		33 653	3 380 444	1,61%	
SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCCA000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		9 037	994 070	0,47%	
SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLOPTT000011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		11 881	3 320 739	1,58%	
SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		26 757	747 591	0,36%	
SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		1 796	258 624	0,12%	
SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLENEA000013	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		12 803	101 336	0,05%	
SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG00022	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		31 331	221 823	0,11%	
SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTC0000037	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		11 201	108 426	0,05%	
SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		2 930	85 790	0,04%	
SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLLOTOS00025	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		15 732	1 314 881	0,63%	
SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK0000017	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		1 564	316 710	0,15%	
SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		10 171	217 456	0,10%	
SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU0327357389	N/D	Akcje	N/D	N/D	UA	PLN		2 731	123 578	0,06%	
SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM000017	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		41 972	4 011 684	1,91%	
SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLLPP000011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		246	2 169 720	1,03%	
SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE000012	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		2 528	984 403	0,47%	
SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL000017	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		125 480	893 418	0,42%	
SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER000010	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		155 064	1 234 309	0,59%	
SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		1 850	37 925	0,02%	
SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU11642887738	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		58 788	2 057 580	0,98%	
SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKN0000018	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		49 212	4 223 374	2,01%	
SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GA	PLPGNI000014	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		317 408	1 373 742	0,65%	
SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO0000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		141 428	4 873 609	2,32%	
SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU0000011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		127 824	5 116 795	2,43%	
SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLBZ00000044	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		7 005	2 153 337	1,02%	
SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAUR000011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		2 110	2 110 450	1,00%	
SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKRUSZ000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		20 340	992 592	0,47%	
SFIO	N/D	PLN	AKCJI MALYCH I SREDNICH SPOLEK	AI0992351914	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	N/D	PL	PLN		1 381	443 454	0,21%	
SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH	AI0992351941	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	N/D	PL	PLN		3 039	344 044	0,16%	
SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AI0992351940	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	N/D	PL	PLN		34 275	3 827 472	1,82%	
SFIO	N/D	PLN	OBLIGACJI DLUGOTERMINOWYCH	AI0992351913	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	N/D	PL	PLN		56 984	13 952 544	6,63%	
SFIO	N/D	PLN	PAPIEROW DLUZNYCH PLUS	AI0992351923	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	N/D	PL	PLN		39 921	7 824 586	3,72%	
SFIO	N/D	PLN	SKARBOWY	AI0992351905	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	N/D	PL	PLN		251	544 538	0,26%	
SFIO	N/D	PLN	DB X-TRACKERS DAX UCITS ETF (DR)	LU0274211480	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	N/D	DE	EUR		1 898	1 032 799	0,49%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	N/D	US	USD		13 061	16 033 273	7,62%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	N/D	US	USD		46 635	7 946 735	3,78%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD	IE0031442068	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	N/D	IE	USD		131 048	15 965 606	7,59%	
SFIO	N/D	PLN	PL WSE F		N/D	Kontrakt terminowy	N/D	N/D	PL	PLN			2 064 174	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	US CME E		N/D	Kontrakt terminowy	N/D	N/D	US	USD			-13 931 970	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	N/D	USD/PLN				1 752 728	0,83%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	N/D	EUR/PLN				82 109	0,04%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	N/D	JPY/PLN				8 555	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Spot-Forward	N/D	N/D	EUR/PLN				-19	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	N/D	JPY				350	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	N/D	USD				25 150 212	11,95%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	N/D	EUR				6 777 635	3,22%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	N/D	PLN				630 407	0,30%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	N/D	USD				428 365	0,20%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	N/D	PLN				9 731 179	4,63%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	N/D	EUR				3 380 078	1,61%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107264	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		2 000	2 183 100	1,04%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108866	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		3 500	3 648 995	1,73%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108197	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		3 000	3 251 070	1,55%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111720	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		5 000	5 120 500	2,43%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111191	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		4 800	5 026 944	2,39%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109492	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		10 100	10 411 585	4,95%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107611	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		2 500	2 668 025	1,27%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110151	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		9 800	10 275 202	4,88%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109427	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		4 700	4 890 209	2,33%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111274	N/D	Obligacje	N/D	N/D	PL	PLN		3 000	2 941 800	1,40%	

## Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluście wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające
SFIO	N/D	PLN	ALIOR BANK SA	PLALIOR000045	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		11 496	329 705	0,34%	
SFIO	N/D	PLN	BANK MILLENNIUM	PLBIG0000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		23 903	139 833	0,14%	
SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKA000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		22 296	2 239 633	2,31%	
SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCCA000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		5 232	575 520	0,59%	
SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLOPTT000011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		8 626	2 410 967	2,48%	
SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		20 736	579 364	0,60%	
SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		1 584	228 096	0,23%	
SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLENEA000013	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		7 822	61 911	0,06%	
SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG00022	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		20 676	146 386	0,15%	
SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTC0000037	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		6 842	66 231	0,07%	
SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		1 789	52 382	0,05%	
SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLLOTOS00025	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		11 725	979 975	1,01%	

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 31/12/2019



Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluście wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające
SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK0000017	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	1 167	236 317	0,24%	
SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	7 149	152 846	0,18%	
SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU0327357389	N/D	Akcje		N/D	N/D	UA	PLN	1 667	75 432	0,08%	
SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM0000017	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	29 483	2 817 985	2,90%	
SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLLPP0000011	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	173	1 525 860	1,57%	
SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE0000012	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	1 775	691 185	0,71%	
SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL000017	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	88 206	628 027	0,65%	
SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER000010	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	108 913	866 947	0,89%	
SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	1 129	23 144	0,02%	
SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU1642887738	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	38 870	1 360 450	1,40%	
SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKN0000018	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	35 182	3 019 319	3,11%	
SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GA	PLPGNI000014	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	222 837	964 439	0,99%	
SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO0000016	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	100 430	3 460 818	3,56%	
SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU0000011	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	68 786	2 753 504	2,84%	
SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLBZ00000044	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	4 442	1 365 471	1,41%	
SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURN00011	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	960 543	1 575 291	1,62%	
SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKRZ0000016	N/D	Akcje		N/D	N/D	PL	PLN	12 180	594 384	0,61%	
SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU WSCHODZACYCH	AI0992351941	N/D	Jednostki uczestnictwa		N/D	N/D	PL	PLN	2 654	300 395	0,31%	
SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AI0992351940	N/D	Jednostki uczestnictwa		N/D	N/D	PL	PLN	22 011	2 457 943	2,53%	
SFIO	N/D	PLN	DB X-TRACKERS DAX UCITS ETF (DR)	LU0274211480	N/D	Tytuły uczestnictwa		N/D	DE	EUR	EUR	1 226	667 129	0,69%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D	Tytuły uczestnictwa		N/D	US	USD	USD	9 021	11 073 896	11,40%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D	Tytuły uczestnictwa		N/D	US	USD	USD	31 544	5 375 186	5,53%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD	IE0031442068	N/D	Tytuły uczestnictwa		N/D	IE	USD	USD	89 628	10 919 399	11,24%	
SFIO	N/D	PLN	PL WSE F		N/D	Kontrakt terminowy		N/D	N/D		USD		1 935 163	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	US CME E		N/D	Kontrakt terminowy		N/D	N/D		USD		-9 287 980	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap		N/D	N/D	EUR	EUR/PLN		44 577	0,06%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap		N/D	N/D	JPY	JPY/PLN		5 708	0,01%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap		N/D	N/D	USD	USD/PLN		1 049 709	1,08%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Spot-Forward		N/D	N/D	EUR	EUR/PLN		-15	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	N/D	EUR	EUR		1 772 799	1,83%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	N/D	JPY	JPY		350	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	N/D	USD	USD		12 524 607	12,90%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	N/D	USD	USD		2 78 654	0,29%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	N/D	PLN	PLN		5 895 014	6,07%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	N/D	PLN	PLN		484 787	0,50%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	N/D	EUR	EUR		3 643 378	3,75%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111274	N/D	Obligacje		N/D	PL	PLN	PLN	3 000	2 941 800	3,03%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107264	N/D	Obligacje		N/D	PL	PLN	PLN	1 400	1 528 170	1,57%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109492	N/D	Obligacje		N/D	PL	PLN	PLN	3 000	3 092 550	3,18%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110151	N/D	Obligacje		N/D	PL	PLN	PLN	3 000	3 145 470	3,24%	

## Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluście wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające	
		SFIO	N/D	PLN	ALIOR BANK SA	PLALIOR000045	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	5 951	170 675	0,45%		
		SFIO	N/D	PLN	BANK MILLENNIUM	PLBIG0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	10 503	61 443	0,16%		
		SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKA000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN	11 997	1 205 099	3,15%	
		SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCC0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	2 993	329 230	0,86%		
		SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLOPTC00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	4 380	1 224 210	3,20%		
		SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	11 663	325 864	0,85%		
		SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 479	212 976	0,56%		
		SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLENEA000013	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	4 141	32 776	0,09%		
		SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG00022	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	8 333	58 998	0,15%		
		SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTZ0000037	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	3 622	35 061	0,09%		
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLAZTRM00012	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	947	27 728	0,07%		
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLLOTOS00025	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	5 950	497 301	1,30%		
		SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK0000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	512	103 680	0,27%		
		SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	3 800	81 244	0,21%		
		SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU0327357389	N/D	Akcje	N/D	UA	PLN	883	39 956	0,10%		
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM0000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	13 981	1 336 304	3,49%		
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLLPP0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	90	793 800	2,07%		
		SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE0000012	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	942	366 815	0,96%		
		SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	46 926	334 113	0,87%		
		SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER000010	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	57 893	460 828	1,20%		
		SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	597	12 238	0,03%		
		SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU1642887738	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	11 463	401 205	1,05%		
		SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKN0000018	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	18 819	1 615 047	4,22%		
		SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GA	PLPGNI000014	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	118 452	512 660	1,34%		
		SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	52 778	1 818 730	4,75%		
		SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	44 159	1 767 685	4,62%		
		SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLBZ00000044	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	2 378	730 997	1,91%		
		SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURN00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	413 666	678 412	1,77%		
		SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKRZ0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	5 100	248 880	0,65%		
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU WSCHODZACYCH	AI0992351941	N/D	Jednostki uczestnictwa		N/D	PL	PLN	1 323	149 807	0,39%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AI0992351940	N/D	Jednostki uczestnictwa		N/D	PL	PLN	7 185	802 388	2,10%	
		SFIO	N/D	PLN	DB X-TRACKERS DAX UCITS ETF (DR)	LU0274211480	N/D	Tytuły uczestnictwa		N/D	DE	EUR	689	374 920	0,98%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D	Tytuły uczestnictwa		N/D	US	USD	5 031	6 175 897	16,14%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D	Tytuły uczestnictwa		N/D	US	USD	17 629	3 004 031	7,85%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD	IE0031442068	N/D	Tytuły uczestnictwa		N/D	IE	USD	49 999	6 091 389	15,92%	
		SFIO	N/D	PLN	PL WSE F		N/D	Kontrakt terminowy		N/D		USD		2 064 174	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN	US CME E		N/D	Kontrakt terminowy		N/D		USD		-5 307 417	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap		N/D	JPY	JPY/PLN		1 794	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap		N/D	EUR	EUR/PLN		18 463	0,05%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap		N/D	USD	USD/PLN		413 955	1,08%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Spot-Forward		N/D	EUR	EUR/PLN		-6	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	USD	USD		51 398	0,13%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	PLN	PLN		1 505 273	3,93%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	EUR	EUR		1 460 344	3,83%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	EUR	EUR		659 652	1,72%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	USD	USD		330 466	0,86%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	PLN	PLN		1 732 715	4,53%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty		N/D	JPY	JPY		350	0,00%	