

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------------|---------------------------|--|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | OBLIGACJI DLUGOTERMINOWYCH          | AI0992351913              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 1 259 214                     | 251 528 068                                   | 13.76%                                      |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SKARBOWY                            | AI0992351905              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 35 291                        | 78 830 009                                    | 4.31%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                                 | PL0000500286              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 318 054                       | 260 099 016                                   | 14.23%                                      |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                                 | PL0000500328              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 40 275                        | 36 113 147                                    | 1.98%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                      | CZ0001006076              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 20 980                        | 26 884 646                                    | 1.47%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                      | CZ0001005375              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 30 249                        | 48 493 094                                    | 2.65%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                      | PLDINPL00045              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16 607                        | 16 649 343                                    | 0.91%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000113783              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 213 532                       | 125 729 777                                   | 6.88%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000108866              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 814   | 0%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000109427              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 779   | 0%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000111498              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 150 000                       | 106 932 000                                   | 5.85%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000112736              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 63 777                        | 38 241 327                                    | 2.09%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA                  | PL0017000020              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 884                           | 9 134 749                                     | 0.5%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA                  | PLECHPS00316              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 8 251                         | 37 346 771                                    | 2.04%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | EUROPEAN INVESTMENT BANK LUXEMBOURG | XS2528186856              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | LU            | LU          | PLN                | 19 706                        | 19 874 833                                    | 1.09%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                             | PLENEA000096              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 540                           | 54 051 856                                    | 2.96%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                                 | PL0000500278              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 205 867                       | 129 967 130                                   | 7.11%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO         | PLGHLMC00529              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9 390                         | 9 719 965                                     | 0.53%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO         | PLGHLMC00511              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16 442                        | 17 127 489                                    | 0.94%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ         | PL0326300061              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 774                           | 807 989                                       | 0.04%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ         | PL0326300079              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 774                           | 807 741                                       | 0.04%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ         | PL0326300095              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 297                         | 3 433 956                                     | 0.19%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000019              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 113                           | 102 425 246                                   | 5.6%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000027              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 111                           | 94 407 264                                    | 5.16%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000092              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 88                            | 62 140 411                                    | 3.4%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000035              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 56                            | 46 005 021                                    | 2.52%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000050              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 34                            | 21 403 124                                    | 1.17%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PL0198500012              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 5 702                         | 5 928 369                                     | 0.32%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PL0037100016              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 295                           | 19 264 960                                    | 1.05%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLPKN0000208              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 192                           | 19 674 246                                    | 1.08%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000114393              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 80 816                        | 67 799 775                                    | 3.71%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000113460              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 882                         | 2 823 612                                     | 0.15%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ROBYG SA                       | PLROBYG00271              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9 970                         | 9 874 178                                     | 0.54%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PL0266300097              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 120                         | 3 719 432                                     | 0.2%  |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|--------------------------|---------------------------|--|-----------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                   | PLO266300063              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 120                         | 4 353 509                                     | 0.24%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                   | PLO266300071              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 820                           | 866 475                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA | PL0144500017              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 38 469                        | 38 507 084                                    | 2.11%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000108817              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 171                         | 5 999 076                                     | 0.33%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111738              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 588                           | 584 948                                       | 0.03%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PLO336300010              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 282                           | 2 946 505                                     | 0.16%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PLO336300028              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 282                           | 2 943 965                                     | 0.16%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PLO336300036              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 282                           | 2 942 401                                     | 0.16%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000110151              | N/D                                    | Aktywa Reverse Repo         | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 4 745 009                                     | 0.26%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111738              | N/D                                    | Aktywa Reverse Repo         | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 14 234 055                                    | 0.78%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Spot-Forward                | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Spot-Forward                | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Gotówka/Depozyty/Należności | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 22 846 924                                    | 1.25%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA            | LU2237380790              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 145 180                       | 3 368 176                                     | 0.36%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA         | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 20 077                        | 1 380 294                                     | 0.15%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK MILLENNIUM          | PLBIG0000016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 19 906                        | 86 790  | 0.01%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK PEKAO                    | PLPEKAO00016              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 63 620                        | 4 990 353                                     | 0.53%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC0000016              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12 491                        | 460 293                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CD PROJEKT SA                 | PLOPTTC00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 25 947                        | 3 297 864                                     | 0.35%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CYFROWY POLSAT SA             | PLCFRPT00013              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 86 081                        | 1 540 850                                     | 0.16%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                | PLDINPL00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 17 140                        | 5 351 108                                     | 0.57%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                       | PLENEA000013              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12 262                        | 63 946  | 0.01%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GLOBE TRADE CENTRE SA         | PLGTC0000037              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 208                         | 43 825  | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA AZOTY SA                | PLZATRM00012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 885                         | 61 828  | 0.01%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA KETY SA                 | PLKETY000011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 310                         | 645 830                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ING POLSKA                    | PLBSK0000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 972                           | 161 741                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA | PLJSW0000015              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 18 521                        | 769 362                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KERNEL HOLDING SA             | LU0327357389              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | UA            | UA          | PLN                | 951                           | 15 739  | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA          | PLKGHM000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 47 184                        | 4 513 621                                     | 0.48%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | LPP SA                        | PLLPP0000011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 380                           | 3 150 200                                     | 0.33%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MBANK                         | PLBRE0000012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 867                         | 1 837 609                                     | 0.19%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ORANGE POLSKA SA              | PLTLKPL00017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 196 759                       | 1 186 850                                     | 0.13%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.              | NL0015000AU7              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 43 365                        | 1 456 197                                     | 0.15%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------|---------------------------|--|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA   | PLPGER000010              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 341 168                       | 1 859 366                                     | 0.2%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKP CARGO SA                    | PLPKPCR00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 190                         | 14 518  | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S  | PLPKN0000018              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 153 190                       | 8 413 195                                     | 0.89%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKIE GORNIC'TWO NAFTOWE I GA | PLPGNIG00014              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 597 130                       | 3 074 025                                     | 0.32%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B  | PLPKO0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 316 668                       | 8 255 535                                     | 0.87%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                             | PLPZU0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 210 617                       | 5 644 536                                     | 0.6%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA           | PLBZ00000044              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11 658                        | 2 963 464                                     | 0.31%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES CORE S&P 500 ETF        | US4642872000              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | US          | USD                | 29 526                        | 54 203 768                                    | 5.73%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES MSCI EMERGING MARKETS   | US4642872349              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | EM          | USD                | 51 682                        | 8 365 014                                     | 0.88%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH       | AI0992351941              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 2 702                         | 231 087                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO         | AI0992351940              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 1 840                         | 229 813                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | OBLIGACJI DLU-GOTERMINOWYCH     | AI0992351913              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 215 358                       | 43 017 827                                    | 4.55%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SKARBOWY                        | AI0992351905              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 242                           | 540 055                                       | 0.06%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | STABILNEGO WZROSTU              | AI0992351902              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 664                           | 102 810                                       | 0.01%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                             | PL0000500286              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 138 755                       | 113 471 420                                   | 11.99%                                      |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                             | PL0000500328              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13 573                        | 12 170 422                                    | 1.29%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                  | CZ0001006076              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 4 624                         | 5 925 386                                     | 0.63%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                      | CZ0001005375              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 6 671                         | 10 694 483                                    | 1.13%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                      | PLDINPL00045              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 776                         | 3 785 628                                     | 0.4%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000113783              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 65 145                        | 38 358 027                                    | 4.05%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000108866              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 814   | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000109427              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 779   | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000111498              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 91 600                        | 65 299 808                                    | 6.9%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000112736              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 57 112                        | 34 244 926                                    | 3.62%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA                  | PL0017000020              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 333                           | 3 441 031                                     | 0.36%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA                  | PLECHPS00316              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 1 862                         | 8 428 031                                     | 0.89%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | EUROPEAN INVESTMENT BANK LUXEMBOURG | XS2528186856              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | LU            | LU          | PLN                | 7 691                         | 7 756 893                                     | 0.82%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                             | PLENEA000096              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 129                           | 12 912 388                                    | 1.36%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                                 | PL0000500278              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 81 591                        | 51 509 703                                    | 5.44%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO              | PLGHLMC00529              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 072                         | 2 144 810                                     | 0.23%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO              | PLGHLMC00511              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 523                         | 3 669 879                                     | 0.39%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PL0326300061              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 166                           | 173 290                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PL0326300079              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 166                           | 173 237                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PL0326300095              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 704                           | 733 244                                       | 0.08%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000112900              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16 739                        | 16 223 439                                    | 1.71%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000019              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 25                            | 22 660 453                                    | 2.4%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000027              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 32                            | 27 216 508                                    | 2.88%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000092              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 21                            | 14 828 962                                    | 1.57%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000035              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 41                            | 33 682 248                                    | 3.56%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000050              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7                             | 4 406 526                                     | 0.47%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PLO198500012              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 218                         | 1 266 355                                     | 0.13%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLO037100016              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 66                            | 4 310 127                                     | 0.46%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLPKN0000208              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 31                            | 3 176 571                                     | 0.34%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000110151              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 32 848                        | 33 138 376                                    | 3.5%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000114393              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 56 570                        | 47 458 836                                    | 5.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000111720              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 63                            | 56 067  | 0.01%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000113460              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 20 551                        | 14 947 975                                    | 1.58%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ROBYG SA                       | PLROBYG00271              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 505                         | 2 480 924                                     | 0.26%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300097              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 880                           | 794 442                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300063              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 880                           | 929 876                                       | 0.1%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300071              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 176                           | 185 975                                       | 0.02%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|--------------------------|---------------------------|--|-----------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA | PL0144500017              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8 518                         | 8 526 433                                     | 0.9%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000108817              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 341                         | 1 303 640                                     | 0.14%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111738              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 138 278                       | 137 560 337                                   | 14.54%                                      |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PL0336300010              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 62                            | 647 813                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PL0336300028              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 62                            | 647 255                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PL0336300036              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 62                            | 646 911                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111738              | N/D                                    | Zobowiązania Repo           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | -100 418 531                                  | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CME (NASDAQ 100 MINI)    |                           | N/D                                    | Kontrakt terminowy          | N/D                   |               |             | USD                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GPW SA (WIG20)           |                           | N/D                                    | Kontrakt terminowy          | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Spot-Forward                | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Spot-Forward                | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Spot-Forward                | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Gotówka/Depozyty/Należności | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 19 047 721                                    | 2.01%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA            | LU2237380790              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 302 404                       | 7 015 773                                     | 1.01%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA         | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 40 184                        | 2 762 650                                     | 0.4%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK PEKAO               | PLPEKAO00016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 127 059                       | 9 966 508                                     | 1.44%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                   | PLCCC0000016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 24 174                        | 890 812                                       | 0.13%                                       |                          |



Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CD PROJEKT SA                 | PLOPTTC00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 51 360                        | 6 527 856                                     | 0.94%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CYFROWY POLSAT SA             | PLCFRPT00013              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 180 400                       | 3 229 160                                     | 0.47%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                | PLDINPL00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 34 501                        | 10 771 212                                    | 1.55%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                       | PLENEA000013              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12 803                        | 66 768  | 0.01%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GLOBE TRADE CENTRE SA         | PLGTC0000037              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11 201                        | 68 102  | 0.01%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA AZOTY SA                | PLZATRM00012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 930                         | 96 104  | 0.01%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA KETY SA                 | PLKETY000011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 644                         | 1 303 492                                     | 0.19%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ING POLSKA                    | PLBSK0000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 564                         | 260 250                                       | 0.04%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA | PLJSW0000015              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 37 950                        | 1 576 443                                     | 0.23%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KERNEL HOLDING SA             | LU0327357389              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | UA            | UA          | PLN                | 1 480                         | 24 494  | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA          | PLKGHM000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 98 430                        | 9 415 814                                     | 1.36%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | LPP SA                        | PLLPP0000011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 755                           | 6 258 950                                     | 0.9%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MBANK                         | PLBRE0000012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9 561                         | 2 558 524                                     | 0.37%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ORANGE POLSKA SA              | PLTLKPL00017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 468 543                       | 2 826 251                                     | 0.41%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.              | NL0015000AU7              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 89 101                        | 2 992 012                                     | 0.43%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA | PLPGER000010              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 612 809                       | 3 339 809                                     | 0.48%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKP CARGO SA                  | PLPKPCR00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 850                         | 22 570  | 0%  |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------|---------------------------|--|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S  | PLPKN0000018              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 299 347                       | 16 440 137                                    | 2.37%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GA | PLPGNIG00014              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 185 016                     | 6 100 462                                     | 0.88%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B  | PLPKO0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 620 032                       | 16 164 234                                    | 2.33%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                             | PLPZU0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 411 732                       | 11 034 418                                    | 1.59%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA           | PLBZ00000044              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 24 078                        | 6 120 628                                     | 0.88%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES CORE S&P 500 ETF        | US4642872000              | N/D                                    | Tytuly i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | US          | USD                | 43 028                        | 78 990 710                                    | 11.39%                                      |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES MSCI EMERGING MARKETS   | US4642872349              | N/D                                    | Tytuly i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | EM          | USD                | 100 644                       | 16 289 781                                    | 2.35%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD   | IE0031442068              | N/D                                    | Tytuly i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | US          | USD                | 161 730                       | 29 585 850                                    | 4.27%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI MALYCH I SREDNICH SPOLEK  | AI0992351914              | N/D                                    | Tytuly i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 1 381                         | 476 725                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH       | AI0992351941              | N/D                                    | Tytuly i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 3 039                         | 259 948                                       | 0.04%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO         | AI0992351940              | N/D                                    | Tytuly i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 34 275                        | 4 280 586                                     | 0.62%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | OBLIGACJI DLU-GOTERMINOWYCH     | AI0992351913              | N/D                                    | Tytuly i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 90 905                        | 18 158 186                                    | 2.62%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SKARBOWY                        | AI0992351905              | N/D                                    | Tytuly i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 231                           | 515 940                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                             | PL0000500286              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 60 854                        | 49 765 340                                    | 7.18%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                             | PL0000500328              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 5 675                         | 5 088 569                                     | 0.73%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                  | CZ0001006076              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 1 983                         | 2 541 099                                     | 0.37%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                  | CZ0001005375              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 2 857                         | 4 580 144                                     | 0.66%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                      | PLDINPL00045              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 619                         | 1 623 128                                     | 0.23%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000113783              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 40 042                        | 23 577 130                                    | 3.4%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000108866              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 814   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000109427              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 779   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000111498              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 46 858                        | 33 404 131                                    | 4.82%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000112736              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 20 022                        | 12 005 391                                    | 1.73%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA                  | PLO017000020              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 169                           | 1 746 349                                     | 0.25%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA                  | PLECHPS00316              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 799                           | 3 616 540                                     | 0.52%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | EUROPEAN INVESTMENT BANK LUXEMBOURG | XS2528186856              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | LU            | LU          | PLN                | 3 997                         | 4 031 245                                     | 0.58%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                             | PLENEA000096              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 55                            | 5 505 282                                     | 0.79%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                                 | PL0000500278              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 62 139                        | 39 229 345                                    | 5.66%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO              | PLGHLMC00529              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 885                           | 916 099                                       | 0.13%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO              | PLGHLMC00511              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 547                         | 1 611 497                                     | 0.23%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PLO326300061              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 73                            | 76 206  | 0.01%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PLO326300079              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 73                            | 76 182  | 0.01%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PLO326300095              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 310                           | 322 877                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000112900              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 835                         | 2 747 682                                     | 0.4%  |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000019              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12                            | 10 877 017                                    | 1.57%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000027              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11                            | 9 355 675                                     | 1.35%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000092              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11                            | 7 767 551                                     | 1.12%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000035              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13                            | 10 679 737                                    | 1.54%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000050              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 1 888 511                                     | 0.27%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PLO198500012              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 536                           | 557 279                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLO037100016              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 28                            | 1 828 539                                     | 0.26%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLPKN0000208              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 43                            | 4 406 211                                     | 0.64%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000110151              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12 240                        | 12 348 202                                    | 1.78%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000114393              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 38 489                        | 32 289 962                                    | 4.66%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000111720              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 54                            | 48 057  | 0.01%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000113460              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 098                        | 7 344 881                                     | 1.06%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ROBYG SA                       | PLROBYG00271              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 051                         | 1 040 899                                     | 0.15%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300097              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 387                           | 349 374                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300063              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 387                           | 408 934                                       | 0.06%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300071              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 77                            | 81 364  | 0.01%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLO144500017              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 634                         | 3 637 598                                     | 0.52%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-----------------------|---------------------------|--|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000108817              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 578                           | 561 897                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000111738              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 88 178                        | 87 720 356                                    | 12.65%                                      |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE         | PL0336300010              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 27                            | 282 112                                       | 0.04%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE         | PL0336300028              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 27                            | 281 869                                       | 0.04%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE         | PL0336300036              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 27                            | 281 719                                       | 0.04%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000111738              | N/D                                    | Zobowiązania Repo               | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | -36 992 714                                   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000113783              | N/D                                    | Zobowiązania Sell-buy back      | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | -7 521 707                                    | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CME (NASDAQ 100 MINI) |                           | N/D                                    | Kontrakt terminowy              | N/D                   |               |             | USD                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GPW SA (WIG20)        |                           | N/D                                    | Kontrakt terminowy              | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                       |                           | N/D                                    | Spot-Forward                    | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                       |                           | N/D                                    | Spot-Forward                    | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                       |                           | N/D                                    | Spot-Forward                    | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA         | LU2237380790              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA      | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                | PLCCC0000016              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.      | NL0015000AU7              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                       |                           | N/D                                    | Gotówka/Depozyty/Należności     | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 23 513 406                                    | 3.39%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA                 | LU2237380790              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 227 831                       | 5 285 679                                     | 1.53%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA              | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 30 800                        | 2 117 500                                     | 0.61%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK PEKAO                    | PLPEKAO00016              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 95 758                        | 7 511 258                                     | 2.17%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC0000016              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 18 781                        | 692 080                                       | 0.2%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CD PROJEKT SA                 | PLOPTTC00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 38 604                        | 4 906 568                                     | 1.42%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CYFROWY POLSAT SA             | PLCFRPT00013              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 136 295                       | 2 439 680                                     | 0.71%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                | PLDINPL00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 25 974                        | 8 109 083                                     | 2.35%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                       | PLENEA000013              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 822                         | 40 792  | 0.01%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GLOBE TRADE CENTRE SA         | PLGTC0000037              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 842                         | 41 599  | 0.01%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA AZOTY SA                | PLZATRM00012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 789                         | 58 679  | 0.02%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA KETY SA                 | PLKETY000011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 998                         | 985 014                                       | 0.29%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ING POLSKA                    | PLBSK0000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 167                         | 194 189                                       | 0.06%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA | PLJSW0000015              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 28 980                        | 1 203 829                                     | 0.35%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KERNEL HOLDING SA             | LU0327357389              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | UA            | UA          | PLN                | 903                           | 14 945  | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA          | PLKGHM000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 74 366                        | 7 113 852                                     | 2.06%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | LPP SA                        | PLLPP0000011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 571                           | 4 733 590                                     | 1.37%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MBANK                         | PLBRE0000012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 117                         | 1 904 509                                     | 0.55%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------|---------------------------|--|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ORANGE POLSKA SA                | PLTLKPL00017              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 353 992                       | 2 135 280                                     | 0.62%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.                | NL0015000AU7              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 67 317                        | 2 260 505                                     | 0.65%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA   | PLPGER000010              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 459 983                       | 2 506 907                                     | 0.73%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKP CARGO SA                    | PLPKPCR00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 129                         | 13 774  | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S  | PLPKN0000018              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 224 511                       | 12 330 144                                    | 3.57%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKIE GORNIC'TWO NAFTOWE I GA | PLPGNIG00014              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 889 874                       | 4 581 071                                     | 1.33%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B  | PLPKO0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 469 138                       | 12 230 428                                    | 3.54%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                             | PLPZU0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 311 631                       | 8 351 711                                     | 2.42%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA           | PLBZ00000044              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 18 191                        | 4 624 152                                     | 1.34%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES CORE S&P 500 ETF        | US4642872000              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | US          | USD                | 31 469                        | 57 770 723                                    | 16.72%                                      |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES MSCI EMERGING MARKETS   | US4642872349              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | EM          | USD                | 76 954                        | 12 455 425                                    | 3.6%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD   | IE0031442068              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | US          | USD                | 138 378                       | 25 313 985                                    | 7.32%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH       | AI0992351941              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 2 654                         | 226 968                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO         | AI0992351940              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 22 011                        | 2 748 925                                     | 0.8%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                             | PL0000500286              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 20 526                        | 16 785 805                                    | 4.86%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                             | PL0000500328              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 831                         | 1 641 792                                     | 0.48%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                  | CZ0001006076              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 634                           | 812 434                                       | 0.24%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                      | CZ0001005375              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 916                           | 1 468 468                                     | 0.42%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                      | PLDINPL00045              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 478                           | 479 219                                       | 0.14%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000113783              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 483                        | 6 172 495                                     | 1.79%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000108866              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 814   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000109427              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 779   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000111498              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13 900                        | 9 909 032                                     | 2.87%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000112736              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 439                         | 1 462 449                                     | 0.42%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA                  | PL0017000020              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 54                            | 558 005                                       | 0.16%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA                  | PLECHPS00316              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 237                           | 1 072 741                                     | 0.31%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | EUROPEAN INVESTMENT BANK LUXEMBOURG | XS2528186856              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | LU            | LU          | PLN                | 1 336                         | 1 347 446                                     | 0.39%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                             | PLENEA000096              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 17                            | 1 701 633                                     | 0.49%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                                 | PL0000500278              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 26 280                        | 16 590 984                                    | 4.8%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO              | PLGHLMC00529              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 284                           | 293 980                                       | 0.09%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO              | PLGHLMC00511              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 473                           | 492 720                                       | 0.14%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PL0326300061              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22                            | 22 966  | 0.01%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PL0326300079              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22                            | 22 959  | 0.01%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PL0326300095              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 95                            | 98 946  | 0.03%                                       |                          |



Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000112900              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 636                         | 6 431 611                                     | 1.86%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000019              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4                             | 3 625 672                                     | 1.05%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000027              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 2 551 548                                     | 0.74%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000092              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4                             | 2 824 564                                     | 0.82%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000035              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16                            | 13 144 292                                    | 3.8%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000050              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 629 504                                       | 0.18%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PLO198500012              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 164                           | 170 511                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLO037100016              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9                             | 587 745                                       | 0.17%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLPKN0000208              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4                             | 409 880                                       | 0.12%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000110151              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 625                         | 4 665 885                                     | 1.35%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000114393              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 19 244                        | 16 144 561                                    | 4.67%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000111720              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 40                            | 35 598  | 0.01%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000113460              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 623                         | 1 907 865                                     | 0.55%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ROBYG SA                       | PLROBYG00271              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 341                           | 337 723                                       | 0.1%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300097              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 119                           | 107 430                                       | 0.03%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300063              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 119                           | 125 745                                       | 0.04%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300071              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 24                            | 25 360  | 0.01%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|--------------------------|---------------------------|--|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA | PL0144500017              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 082                         | 1 083 071                                     | 0.31%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000108817              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 183                           | 177 902                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111738              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 15 617                        | 15 535 948                                    | 4.5%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PL0336300010              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8                             | 83 589  | 0.02%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PL0336300028              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8                             | 83 517  | 0.02%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PL0336300036              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8                             | 83 472  | 0.02%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111738              | N/D                                    | Zobowiązania Repo               | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | -4 575 961                                    | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CME (NASDAQ 100 MINI)    |                           | N/D                                    | Kontrakt terminowy              | N/D                   |               |             | USD                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GPW SA (WIG20)           |                           | N/D                                    | Kontrakt terminowy              | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Spot-Forward                    | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Spot-Forward                    | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Spot-Forward                    | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA            | LU2237380790              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA         | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                   | PLCCC0000016              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA     | PLKGHM000017              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.         | NL0015000AU7              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------|--|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                           | PLPZU0000011              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                               |                           | N/D                                    | Gotówka/ Depozyty/ Należności   | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 13 788 405                                    | 3.99%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA                 | LU2237380790              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 121 830                       | 2 826 456                                     | 2.2%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA              | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16 287                        | 1 119 731                                     | 0.87%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK PEKAO                    | PLPEKAO00016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 51 389                        | 4 030 953                                     | 3.14%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 174                        | 374 912                                       | 0.29%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CD PROJEKT SA                 | PLOPTTC00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 20 594                        | 2 617 497                                     | 2.04%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CYFROWY POLSAT SA             | PLCFRPT00013              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 73 543                        | 1 316 420                                     | 1.03%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                | PLDINPL00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13 818                        | 4 313 980                                     | 3.36%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                       | PLENEA000013              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 141                         | 21 595  | 0.02%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GLOBE TRADE CENTRE SA         | PLGTC0000037              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 622                         | 22 022  | 0.02%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA AZOTY SA                | PLZATRM00012              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 947                           | 31 062  | 0.02%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA KETY SA                 | PLKETY000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 048                         | 516 664                                       | 0.4%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ING POLSKA                    | PLBSK0000017              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 512                           | 85 197  | 0.07%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA | PLJSW0000015              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 15 371                        | 638 511                                       | 0.5%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KERNEL HOLDING SA             | LU0327357389              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | UA            | UA          | PLN                | 477                           | 7 894   | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA          | PLKGHM000017              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 39 949                        | 3 821 521                                     | 2.98%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------|---------------------------|--|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | LPP SA                          | PLLP0000011               | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 304                           | 2 520 160                                     | 1.97%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MBANK                           | PLBRE0000012              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 763                         | 1 006 979                                     | 0.79%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ORANGE POLSKA SA                | PLTLKPL00017              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 192 457                       | 1 160 901                                     | 0.91%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.                | NL0015000AU7              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 35 597                        | 1 195 347                                     | 0.93%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA   | PLPGER000010              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 254 738                       | 1 388 322                                     | 1.08%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKP CARGO SA                    | PLPKPCR00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 597                           | 7 283   | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S  | PLPKN0000018              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 118 115                       | 6 486 876                                     | 5.06%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GA | PLPGNIG00014              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 475 480                       | 2 447 771                                     | 1.91%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B  | PLPKO0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 251 643                       | 6 560 333                                     | 5.12%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                             | PLPZU0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 167 245                       | 4 482 166                                     | 3.49%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA           | PLBZ00000044              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9 694                         | 2 464 215                                     | 1.92%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES CORE S&P 500 ETF        | US4642872000              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | US          | USD                | 12 072                        | 22 161 752                                    | 17.28%                                      |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES MSCI EMERGING MARKETS   | US4642872349              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | EM          | USD                | 40 282                        | 6 519 862                                     | 5.08%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD   | IE0031442068              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | US          | USD                | 116 287                       | 21 272 799                                    | 16.59%                                      |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH       | AI0992351941              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 1 323                         | 113 189                                       | 0.09%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO         | AI0992351940              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 12 752                        | 1 592 597                                     | 1.24%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                             | PL0000500286              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 016                         | 1 648 650                                     | 1.29%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------------|---------------------------|--|-----------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                                 | PL0000500328              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 252                           | 225 959                                       | 0.18%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                      | CZ0001006076              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 84                            | 107 641                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                      | CZ0001005375              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 121                           | 193 979                                       | 0.15%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                      | PLDINPL00045              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 64                            | 64 163  | 0.05%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000113783              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 249                         | 735 424                                       | 0.57%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000111498              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 000                         | 1 425 760                                     | 1.11%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA               | PL0000112736              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 376                         | 1 424 673                                     | 1.11%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA                  | PL0017000020              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8                             | 82 667  | 0.06%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA                  | PLECHPS00316              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 32                            | 144 843                                       | 0.11%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | EUROPEAN INVESTMENT BANK LUXEMBOURG | XS2528186856              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | LU            | LU          | PLN                | 188                           | 189 611                                       | 0.15%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                             | PLENEA000096              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2                             | 200 192                                       | 0.16%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                                 | PL0000500278              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 307                         | 2 719 078                                     | 2.12%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO              | PLGHLMC00529              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 38                            | 39 335  | 0.03%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO              | PLGHLMC00511              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 63                            | 65 627  | 0.05%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PL0326300061              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 3 132   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PL0326300079              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 3 131   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ              | PL0326300095              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13                            | 13 540  | 0.01%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|--|--------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000035              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 2 464 555                                     | 1.92%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PLO198500012              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22                            | 22 873  | 0.02%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLO037100016              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 65 305  | 0.05%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000114393              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 081                         | 2 584 774                                     | 2.02%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ROBYG SA                       | PLROBYG00271              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 46                            | 45 558  | 0.04%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300097              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16                            | 14 444  | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300063              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16                            | 16 907  | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300071              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 3 170   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLO144500017              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 142                           | 142 141                                       | 0.11%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000108817              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 25                            | 24 304  | 0.02%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000111738              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 124                         | 2 112 976                                     | 1.65%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PLO336300010              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 10 449  | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PLO336300028              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 10 440  | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PLO336300036              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 10 434  | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CME (NASDAQ 100 MINI)          |                           | N/D                                    | Kontrakt terminowy | N/D                   |               |             | USD                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GPW SA (WIG20)                 |                           | N/D                                    | Kontrakt terminowy | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                                |                           | N/D                                    | Spot-Forward       | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------|---------------------------|--|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                      |                           | N/D                                    | Spot-Forward                    | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                      |                           | N/D                                    | Spot-Forward                    | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA        | LU2237380790              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA     | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA               | PLCCC0000016              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA | PLKGHM000017              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MBANK                | PLBRE0000012              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.     | NL0015000AU7              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                  | PLPZU0000011              | N/D                                    | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                      |                           | N/D                                    | Gotówka/Depozyty/Należności     | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 5 639 243                                     | 4.4%  |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA        | LU2237380790              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 511                         | 174 255                                       | 2.19%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA     | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 000                         | 68 750  | 0.87%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK PEKAO           | PLPEKAO00016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 156                         | 247 557                                       | 3.12%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA               | PLCCC0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 608                           | 22 405  | 0.28%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CD PROJEKT SA        | PLOPTTC00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 265                         | 160 782                                       | 2.02%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CYFROWY POLSAT SA    | PLCFRPT00013              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 516                         | 80 836  | 1.02%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA       | PLDINPL00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 849                           | 265 058                                       | 3.34%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------|---------------------------|--|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA   | PLJSW0000015              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 944                           | 39 214  | 0.49%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA            | PLKGHM000017              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 453                         | 234 654                                       | 2.95%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | LPP SA                          | PLLPP0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 19                            | 157 510                                       | 1.98%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MBANK                           | PLBRE0000012              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 231                           | 61 816  | 0.78%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MERCATOR MEDICAL SA             | PLMRC'TR00015             | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10                            | 483   | 0.01%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ORANGE POLSKA SA                | PLTLKPL00017              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11 819                        | 71 292  | 0.9%  |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.                | NL0015000AU7              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 2 186                         | 73 406  | 0.92%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA   | PLPGER000010              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 14 893                        | 81 167  | 1.02%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S  | PLPKN0000018              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 183                         | 394 490                                       | 4.97%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKIE GORNIC'TWO NAFTOWE I GA | PLPGNIG00014              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 29 200                        | 150 322                                       | 1.89%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B  | PLPKO0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 15 454                        | 402 886                                       | 5.07%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                             | PLPZU0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 271                        | 275 263                                       | 3.47%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA           | PLBZ00000044              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 595                           | 151 249                                       | 1.9%  |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES CORE S&P 500 ETF        | US4642872000              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | US          | USD                | 713                           | 1 308 924                                     | 16.48%                                      |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES MSCI EMERGING MARKETS   | US4642872349              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | EM          | USD                | 2 372                         | 383 921                                       | 4.83%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD   | IE0031442068              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | US          | USD                | 7 169                         | 1 311 451                                     | 16.51%                                      |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO         | AI0992351940              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 88                            | 10 983  | 0.14%                                       |                          |



## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2022-10-31



(continued)

| 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 | Kraj ryzyka | Waluta instrumentu | Ilość instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu | Procentowy udział w wartości aktywów ogółem | Informacje uzupełniające |
|--|---|--------------|---------------------------------------|------------------------|-----------------------|---------------------------|--|-----------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------|
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000114393              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 600                         | 1 342 304                                     | 16.9%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000114393              | N/D                                    | Zobowiązania Repo           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | -845 044                                      | 0%  |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GPW SA (WIG20)        |                           | N/D                                    | Kontrakt terminowy          | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                       |                           | N/D                                    | Spot-Forward                | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                       |                           | N/D                                    | Spot-Forward                | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                       |                           | N/D                                    | Gotówka/Depozyty/Należności | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 302 766                                       | 3.81%                                       |                          |