

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



| 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 DLU-GOTERMINOWYCH | AI0992351913              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 648 212                       | 164 386 607                                   | 6.28%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PAPIEROW DLUZNYCH PLUS      | AI0992351923              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 719 094                       | 143 869 127                                   | 5.49%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SKARBOWY                    | AI0992351905              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 35 291                        | 83 636 674                                    | 3.19%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                         | PL0000500286              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 237 994                       | 240 954 645                                   | 9.2%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC              | CZ0001006076              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 15 474                        | 23 697 539                                    | 0.9%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC              | CZ0001005888              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 31 944                        | 53 601 809                                    | 2.05%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA              | PLDINPL00045              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16 607                        | 16 624 864                                    | 0.63%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA       | PL0000108197              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 27 000                        | 30 261 060                                    | 1.16%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA       | PL0000108866              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 18 700                        | 20 273 979                                    | 0.77%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA       | PL0000109427              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 800                         | 4 120 606                                     | 0.16%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA       | PL0000112736              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 242 245                       | 231 714 610                                   | 8.85%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA          | PLECHPS00316              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 8 251                         | 37 320 205                                    | 1.43%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                     | PLENEA000096              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 570                           | 58 034 590                                    | 2.22%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                     | PLENEA150622              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 36                            | 36 285 851                                    | 1.39%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                         | PL0000500278              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 75 870                        | 76 096 093                                    | 2.91%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO      | PLGHLMC00529              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9 390                         | 9 494 041                                     | 0.36%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO      | PLGHLMC00511              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16 442                        | 16 866 298                                    | 0.64%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | GINA MIASTO GRUDZIADZ          | PL0326300061              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 774                           | 777 621                                       | 0.03%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GINA MIASTO GRUDZIADZ          | PL0326300079              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 774                           | 778 287                                       | 0.03%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GINA MIASTO GRUDZIADZ          | PL0326300095              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 297                         | 3 321 419                                     | 0.13%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000112165              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 39                            | 38 965  | 0%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEKAO BANK HIPOTECZNY SA       | PL0100600058              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 5 661                         | 56 700 580                                    | 2.17%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000019              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 148                           | 150 629 781                                   | 5.75%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000027              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 111                           | 112 258 982                                   | 4.29%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000092              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 88                            | 84 846 097                                    | 3.24%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000035              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 48                            | 48 197 116                                    | 1.84%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000050              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 34                            | 33 740 487                                    | 1.29%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PL0198500012              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 5 702                         | 5 750 785                                     | 0.22%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PL0037100016              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 295                           | 29 946 336                                    | 1.14%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLPKN0000208              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 311                           | 31 460 420                                    | 1.2%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKO BANK HIPOTECZNY            | PL0219200246              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 194                           | 96 854 327                                    | 3.7%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000109492              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 300                           | 306 642                                       | 0.01%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000112728              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 202 206                       | 201 494 235                                   | 7.69%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | STARTS                         | XS2257851472              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | IE            | IL          | PLN                | 4 067                         | 40 291 769                                    | 1.54%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                   | PLO266300097              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 120                         | 4 144 007                                     | 0.16%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                   | PLO266300063              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 120                         | 4 121 755                                     | 0.16%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                   | PLO266300071              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 820                           | 820 349                                       | 0.03%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA | PLO144500017              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 38 469                        | 38 859 940                                    | 1.48%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | WARSZAWA                 | PLO135900028              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 997                         | 3 009 093                                     | 0.11%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | WARSZAWA                 | PLO135900010              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 498                         | 2 510 064                                     | 0.1%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000107611              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13 830                        | 15 017 444                                    | 0.57%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000108817              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 171                         | 6 194 326                                     | 0.24%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111738              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 310 959                       | 312 467 151                                   | 11.93%                                      |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PLO336300010              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 282                           | 2 830 068                                     | 0.11%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PLO336300028              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 282                           | 2 831 415                                     | 0.11%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PLO336300036              | N/D                                    | Obligacje            | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 282                           | 2 832 663                                     | 0.11%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000108817              | N/D                                    | Aktywa Reverse Repo  | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 25 698 595                                    | 0.98%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111738              | N/D                                    | Aktywa Reverse Repo  | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 25 150 291                                    | 0.96%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000109377              | N/D                                    | Aktywa Buy-sell back | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 7 017 742                                     | 0.27%                                       |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CBOT (T NOTE 10Y)        |                           | N/D                                    | Kontrakt terminowy   | N/D                   |               |             | USD                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO034                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                          |                           | N/D                                    | Spot-Forward         | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    |                               |                           | 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                             | 19 843 715                                    | 0.76%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALIOR BANK SA                 | PLALIOR00045              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 21 451                        | 723 757                                       | 0.09%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA                 | LU2237380790              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 78 952                        | 4 552 372                                     | 0.57%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK MILLENNIUM               | PLBIG0000016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 19 906                        | 99 331  | 0.01%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK PEKAO                    | PLPEKAO00016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 43 546                        | 4 178 674                                     | 0.52%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC0000016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 165                        | 1 227 932                                     | 0.15%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CD PROJEKT SA                 | PLOPTTC00011              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 18 854                        | 3 181 424                                     | 0.4%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CYFROWY POLSAT SA             | PLCFRPT00013              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 48 952                        | 1 493 036                                     | 0.19%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                | PLDINPL00011              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11 570                        | 3 292 822                                     | 0.41%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                       | PLENEA000013              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12 262                        | 106 373                                       | 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                         | 49 735  | 0.01%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA AZOTY SA                | PLZATRM00012              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 885                         | 65 032  | 0.01%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA LOTOS SA                | PLLOTOS00025              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 20 210                        | 1 048 091                                     | 0.13%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ING POLSKA                    | PLBSK0000017              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 972                           | 192 456                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA | PLJSW0000015              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12 744                        | 465 029                                       | 0.06%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KERNEL HOLDING SA             | LU0327357389              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | UA            | UA          | PLN                | 1 757                         | 101 730                                       | 0.01%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA           | PLKGHM000017              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 43 791                        | 8 845 782                                     | 1.11%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | LPP SA                         | PLLPP0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 316                           | 3 539 200                                     | 0.44%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MBANK                          | PLBRE0000012              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 156                         | 954 374                                       | 0.12%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ORANGE POLSKA SA               | PLTLKPL00017              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 156 928                       | 1 043 571                                     | 0.13%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.               | NL0015000AU7              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 8 487                         | 373 428                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA  | PLPGER000010              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 200 563                       | 2 002 822                                     | 0.25%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKP CARGO SA                   | PLPKPCR00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 190                         | 25 109  | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S | PLPKN0000018              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 76 497                        | 6 257 455                                     | 0.78%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GA | PLPGNIG00014              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 447 999                       | 2 951 417                                     | 0.37%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B | PLPKO0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 226 276                       | 9 202 645                                     | 1.15%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                            | PLPZU0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 148 760                       | 5 513 046                                     | 0.69%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA          | PLBZ00000044              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8 338                         | 2 226 246                                     | 0.28%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLTAURN00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 364 736                       | 1 223 689                                     | 0.15%                                       |                          |
| 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                | 24 480                        | 37 906 483                                    | 4.75%                                       |                          |
| 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                | 43 537                        | 8 772 905                                     | 1.1%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD  | IE0031442068              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | US          | USD                | 49 616                        | 7 656 684                                     | 0.96%                                       |                          |
| 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                         | 357 613                                       | 0.04%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO    | AI0992351940              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 1 840                         | 235 610                                       | 0.03%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DOBR LUKSUSOWYCH GLOBALNY  | AI0992351926              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | OBLIGACJI DLUGOTERMINOWYCH | AI0992351913              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 121 374                       | 30 780 444                                    | 3.85%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PAPIEROW DLUZNYCH PLUS     | AI0992351923              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 110 611                       | 22 129 946                                    | 2.77%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SKARBOWY                   | AI0992351905              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 242                           | 572 985                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | STABILNEGO WZROSTU         | AI0992351902              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 664                           | 125 986                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                        | PL0000500286              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 57 664                        | 58 381 340                                    | 7.31%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC             | CZ0001006076              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 3 409                         | 5 220 687                                     | 0.65%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC             | CZ0001005888              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 7 045                         | 11 821 461                                    | 1.48%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA             | PLDINPL00045              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 776                         | 3 780 062                                     | 0.47%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000108197              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 666                        | 11 954 239                                    | 1.5%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000108866              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 18 353                        | 19 897 772                                    | 2.49%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000109427              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 798                         | 1 949 697                                     | 0.24%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000107264              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 14 883                        | 16 530 697                                    | 2.07%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000112736              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 38 967                        | 37 273 105                                    | 4.67%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA         | PLECHPS00316              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 1 862                         | 8 422 036                                     | 1.05%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                    | PLENEA000096              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 129                           | 13 134 144                                    | 1.64%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | ENEA SA                        | PLENEA150622              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8                             | 8 063 522                                     | 1.01%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                            | PL0000500278              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16 591                        | 16 640 441                                    | 2.08%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO         | PLGHLMO0529               | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 072                         | 2 094 958                                     | 0.26%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO         | PLGHLMO0511               | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 523                         | 3 613 914                                     | 0.45%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GINIA MIASTO GRUDZIADZ         | PLO326300061              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 166                           | 166 777                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GINIA MIASTO GRUDZIADZ         | PLO326300079              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 166                           | 166 920                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GINIA MIASTO GRUDZIADZ         | PLO326300095              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 704                           | 709 214                                       | 0.09%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEKAO BANK HIPOTECZNY SA       | PLO1006000058             | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 289                         | 12 910 625                                    | 1.62%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000019              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 30                            | 30 533 064                                    | 3.82%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000027              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 32                            | 32 362 950                                    | 4.05%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000092              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 21                            | 20 247 364                                    | 2.53%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000035              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10                            | 10 041 066                                    | 1.26%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000050              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7                             | 6 946 571                                     | 0.87%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PLO198500012              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 218                         | 1 228 421                                     | 0.15%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLO037100016              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 66                            | 6 699 858                                     | 0.84%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLPKN0000208              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 66                            | 6 676 488                                     | 0.84%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKO BANK HIPOTECZNY            | PLO219200246              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 43                            | 21 467 712                                    | 2.69%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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    | PL0000110151              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 32 848                        | 34 328 459                                    | 4.3%  |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111191              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 24 474                        | 25 932 650                                    | 3.25%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000112728              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 51 234                        | 51 053 656                                    | 6.39%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000109153              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 26 900                        | 27 374 516                                    | 3.43%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111720              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 189                         | 2 337 546                                     | 0.29%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | STARTS                   | XS2257851472              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | IE            | IL          | PLN                | 901                           | 8 926 207                                     | 1.12%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                   | PL0266300097              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 880                           | 885 128                                       | 0.11%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                   | PL0266300063              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 880                           | 880 375                                       | 0.11%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                   | PL0266300071              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 176                           | 176 075                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA | PL0144500017              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8 518                         | 8 604 564                                     | 1.08%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | WARSZAWA                 | PL0135900028              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 640                           | 642 582                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | WARSZAWA                 | PL0135900010              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 534                           | 536 579                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000108817              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 341                         | 1 346 069                                     | 0.17%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111738              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 51 177                        | 51 425 208                                    | 6.44%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PL0336300010              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 62                            | 622 213                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PL0336300028              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 62                            | 622 510                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PL0336300036              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 62                            | 622 784                                       | 0.08%                                       |                          |



Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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 | PL0000111738              | N/D                                    | Aktywa Reverse Repo         | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 12 072 140                                    | 1.51%                                       |                          |
| PKO035                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000109377              | N/D                                    | Aktywa Buy-sell back        | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0                             | 7 017 742                                     | 0.88%                                       |                          |
| 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                             | 20 547 262                                    | 2.57%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALIOR BANK SA         | PLALIOR00045              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 34 753                        | 1 172 566                                     | 0.25%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA         | LU2237380790              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 127 867                       | 7 372 811                                     | 1.55%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA      | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 478                         | 254 937                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK MILLENNIUM       | PLBIG0000016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 32 042                        | 159 890                                       | 0.03%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK PEKAO            | PLPEKAO00016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 70 767                        | 6 790 801                                     | 1.43%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                | PLCCC0000016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16 834                        | 2 033 547                                     | 0.43%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CD PROJEKT SA         | PLOPTTC00011              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 30 985                        | 5 228 409                                     | 1.1%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CYFROWY POLSAT SA     | PLCFRPT00013              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 81 492                        | 2 485 506                                     | 0.52%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA        | PLDINPL00011              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 19 288                        | 5 489 365                                     | 1.15%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA               | PLENEA000013              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12 803                        | 111 066                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GLOBE TRADE CENTRE SA | PLGTC0000037              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11 201                        | 77 287  | 0.02%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | GRUPA AZOTY SA                 | PLZATRM00012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 930                         | 101 085                                       | 0.02%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA LOTOS SA                 | PLLOTOS00025              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 32 945                        | 1 708 528                                     | 0.36%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ING POLSKA                     | PLBSK0000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 564                         | 309 672                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA  | PLJSW0000015              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 20 642                        | 753 227                                       | 0.16%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KERNEL HOLDING SA              | LU0327357389              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | UA            | UA          | PLN                | 2 731                         | 158 125                                       | 0.03%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA           | PLKGHM0000017             | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 69 096                        | 13 957 392                                    | 2.93%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | LPP SA                         | PLPPP0000011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 506                           | 5 667 200                                     | 1.19%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MBANK                          | PLBRE0000012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 313                         | 1 304 251                                     | 0.27%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ORANGE POLSKA SA               | PLTLKPL00017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 254 161                       | 1 690 171                                     | 0.36%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.               | NL0015000AU7              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 13 699                        | 602 756                                       | 0.13%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA  | PLPGER0000010             | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 313 452                       | 3 130 132                                     | 0.66%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKP CARGO SA                   | PLPKPCR00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 850                         | 39 035  | 0.01%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S | PLPKN0000018              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 118 684                       | 9 708 351                                     | 2.04%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKIE GORNICtwo NAPTOWE I GA | PLPGNIG000014             | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 672 025                       | 4 427 301                                     | 0.93%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B | PLPKO0000016              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 355 591                       | 14 461 886                                    | 3.04%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                            | PLPZU0000011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 240 792                       | 8 923 752                                     | 1.88%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA          | PLBZ00000044              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13 612                        | 3 634 404                                     | 0.76%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLTAURN00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 623 916                       | 2 093 238                                     | 0.44%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES CORE S&P 500 ETF       | US4642872000              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | US          | USD                | 20 771                        | 32 163 218                                    | 6.76%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES MSCI EMERGING MARKETS  | US4642872349              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | US            | EM          | USD                | 60 797                        | 12 250 874                                    | 2.58%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD  | IE0031442068              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | US          | USD                | 263 007                       | 40 586 935                                    | 8.53%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI MALYCH I SREDNICH SPOLEK | AI0992351914              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 1 381                         | 583 556                                       | 0.12%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI PLUS                     | AI0992351920              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH      | AI0992351941              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 3 039                         | 402 277                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKU AMERYKANSKIEGO     | AI0992351939              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO        | AI0992351940              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 34 275                        | 4 388 552                                     | 0.92%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | OBLIGACJI DLUGOTERMINOWYCH     | AI0992351913              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 56 984                        | 14 451 155                                    | 3.04%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PAPIEROW DLUZNYCH PLUS         | AI0992351923              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 39 921                        | 7 987 066                                     | 1.68%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SKARBOWY                       | AI0992351905              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 231                           | 547 400                                       | 0.12%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                            | PL0000500286              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 26 158                        | 26 483 406                                    | 5.57%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                 | CZ0001006076              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 1 462                         | 2 238 969                                     | 0.47%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                 | CZ0001005888              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 3 018                         | 5 064 183                                     | 1.06%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                 | PLDINPL00045              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 619                         | 1 620 742                                     | 0.34%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000108197              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 492                         | 8 396 884                                     | 1.77%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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     | PL0000108866              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 383                         | 4 751 917                                     | 1%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA     | PL0000109427              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 905                           | 981 355                                       | 0.21%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA     | PL0000107264              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 521                         | 2 800 100                                     | 0.59%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA     | PL0000111498              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 358                         | 1 489 970                                     | 0.31%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA     | PL0000112736              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13 980                        | 13 372 289                                    | 2.81%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA        | PLECHPS00316              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 799                           | 3 613 967                                     | 0.76%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                   | PLENEA000096              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 55                            | 5 599 829                                     | 1.18%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                   | PLENEA150622              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 3 023 821                                     | 0.64%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                       | PL0000500278              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 139                         | 7 160 274                                     | 1.51%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO    | PLGHLMC00529              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 885                           | 894 806                                       | 0.19%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO    | PLGHLMC00511              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 547                         | 1 586 921                                     | 0.33%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ    | PLO326300061              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 73                            | 73 342  | 0.02%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ    | PLO326300079              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 73                            | 73 404  | 0.02%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ    | PLO326300095              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 310                           | 312 296                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEKAO BANK HIPOTECZNY SA  | PLO100600058              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 553                           | 5 538 848                                     | 1.16%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA | PLPFR0000019              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12                            | 12 213 226                                    | 2.57%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA | PLPFR0000027              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11                            | 11 124 764                                    | 2.34%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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      | PLPFR0000092              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11                            | 10 605 762                                    | 2.23%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000035              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 3 012 320                                     | 0.63%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000050              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 2 977 102                                     | 0.63%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOŚCI S | PL0198500012              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 536                           | 540 586                                       | 0.11%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PL0037100016              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 28                            | 2 842 364                                     | 0.6%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLPKN0000208              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 30                            | 3 034 767                                     | 0.64%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKO BANK HIPOTECZNY            | PL0219200246              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 18                            | 8 986 484                                     | 1.89%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000110151              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12 240                        | 12 791 657                                    | 2.69%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000111191              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9 815                         | 10 399 974                                    | 2.19%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000112728              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 20 879                        | 20 805 506                                    | 4.37%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000109153              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 800                        | 10 990 512                                    | 2.31%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000111720              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 739                           | 789 149                                       | 0.17%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | STARTS                         | XS2257851472              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | IE            | IL          | PLN                | 384                           | 3 804 288                                     | 0.8%  |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PL0266300097              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 387                           | 389 255                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PL0266300063              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 387                           | 387 165                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PL0266300071              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 77                            | 77 033  | 0.02%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PL0144500017              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 634                         | 3 670 930                                     | 0.77%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | WARSZAWA              | PLO135900028              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 282                           | 283 138                                       | 0.06%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | WARSZAWA              | PLO135900010              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 235                           | 236 135                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000107611              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 350                         | 3 637 631                                     | 0.76%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000108817              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 578                           | 580 185                                       | 0.12%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000111738              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 25 998                        | 26 124 090                                    | 5.49%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE         | PL0336300010              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 27                            | 270 964                                       | 0.06%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE         | PL0336300028              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 27                            | 271 093                                       | 0.06%                                       |                          |
| PKO036                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE         | PL0336300036              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 27                            | 271 212                                       | 0.06%                                       |                          |
| 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                    |                       |                           | N/D                                    | Gotówka/Depozyty/Należności | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 11 806 848                                    | 2.48%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALIOR BANK SA         | PLALIOR00045              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22 648                        | 764 144                                       | 0.32%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA         | LU2237380790              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 91 010                        | 5 247 637                                     | 2.23%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA      | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 243                         | 311 012                                       | 0.13%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK MILLENNIUM       | PLBIG0000016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 23 903                        | 119 276                                       | 0.05%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | BANK PEKAO                    | PLPEKAO00016              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 51 475                        | 4 939 541                                     | 2.1%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC0000016              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 346                        | 1 249 797                                     | 0.53%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CD PROJEKT SA                 | PLOPTTC00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22 270                        | 3 757 840                                     | 1.59%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CYFROWY POLSAT SA             | PLCFRPT00013              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 55 283                        | 1 686 132                                     | 0.72%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                | PLDINPL00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 14 288                        | 4 066 365                                     | 1.73%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                       | PLENEA000013              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 822                         | 67 856  | 0.03%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GLOBE TRADE CENTRE SA         | PLGTC0000037              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 842                         | 47 210  | 0.02%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA AZOTY SA                | PLZATRM00012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 789                         | 61 720  | 0.03%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA LOTOS SA                | PLLOTOS00025              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22 585                        | 1 171 258                                     | 0.5%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ING POLSKA                    | PLBSK0000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 167                         | 231 066                                       | 0.1%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA | PLJSW0000015              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13 752                        | 501 810                                       | 0.21%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KERNEL HOLDING SA             | LU0327357389              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | UA            | UA          | PLN                | 1 667                         | 96 519  | 0.04%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA          | PLKGHM000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 47 296                        | 9 553 792                                     | 4.05%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | LPP SA                        | PLLPP0000011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 321                           | 3 595 200                                     | 1.53%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MBANK                         | PLBRE0000012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 418                         | 731 203                                       | 0.31%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ORANGE POLSKA SA              | PLTLKPL00017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 169 440                       | 1 126 776                                     | 0.48%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.              | NL0015000AU7              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 10 202                        | 448 888                                       | 0.19%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA   | PLPGER000010              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 208 898                       | 2 086 055                                     | 0.88%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKP CARGO SA                    | PLPKPCR00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 129                         | 23 822  | 0.01%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S  | PLPKN0000018              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 87 002                        | 7 116 764                                     | 3.02%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKIE GORNIC'TWO NAFTOWE I GA | PLPGNIG00014              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 493 540                       | 3 251 442                                     | 1.38%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B  | PLPKO0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 259 565                       | 10 556 509                                    | 4.48%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                             | PLPZU0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 171 099                       | 6 340 929                                     | 2.69%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA           | PLBZ00000044              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8 608                         | 2 298 336                                     | 0.97%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA        | PLTAURN00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 463 544                       | 1 555 190                                     | 0.66%                                       |                          |
| 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                | 15 510                        | 24 016 730                                    | 10.19%                                      |                          |
| 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                | 43 041                        | 8 672 959                                     | 3.68%                                       |                          |
| 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                | 189 676                       | 29 270 580                                    | 12.42%                                      |                          |
| 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                         | 351 239                                       | 0.15%                                       |                          |
| 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                        | 2 818 259                                     | 1.2%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                             | PL0000500286              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 022                        | 10 146 674                                    | 4.3%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                  | CZ0001006076              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 468                           | 716 715                                       | 0.3%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                  | CZ0001005888              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 967                           | 1 622 619                                     | 0.69%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                  | PLDINPL00045              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 478                           | 478 514                                       | 0.2%  |                          |



Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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     | PL0000108197              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 303                         | 2 581 156                                     | 1.09%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA     | PL0000108866              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 269                         | 2 459 982                                     | 1.04%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA     | PL0000109427              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 291                           | 315 552                                       | 0.13%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA     | PL0000107264              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 5 900                         | 6 553 189                                     | 2.78%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA     | PL0000112736              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 956                         | 6 653 623                                     | 2.82%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA        | PLECHPS00316              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 237                           | 1 071 978                                     | 0.45%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                   | PLENEA000096              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 17                            | 1 730 856                                     | 0.73%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                   | PLENEA150622              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 1 007 940                                     | 0.43%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                       | PL0000500278              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 280                         | 2 286 794                                     | 0.97%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO    | PLGHLMC00529              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 284                           | 287 147                                       | 0.12%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO    | PLGHLMC00511              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 473                           | 485 206                                       | 0.21%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ    | PLO326300061              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22                            | 22 103  | 0.01%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ    | PLO326300079              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22                            | 22 122  | 0.01%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ    | PLO326300095              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 95                            | 95 704  | 0.04%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEKAO BANK HIPOTECZNY SA  | PLO100600058              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 163                           | 1 632 608                                     | 0.69%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA | PLPFR0000019              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4                             | 4 071 075                                     | 1.73%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA | PLPFR0000027              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 3 034 027                                     | 1.29%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000092              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4                             | 3 856 641                                     | 1.64%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000035              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 1 004 107                                     | 0.43%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000050              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 992 367                                       | 0.42%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PLO198500012              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 164                           | 165 403                                       | 0.07%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLO037100016              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9                             | 913 617                                       | 0.39%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLPKN0000208              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10                            | 1 011 589                                     | 0.43%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKO BANK HIPOTECZNY            | PLO219200246              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6                             | 2 995 495                                     | 1.27%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000110151              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 625                         | 4 833 449                                     | 2.05%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000111191              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 808                         | 2 975 357                                     | 1.26%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000112728              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 5 235                         | 5 216 573                                     | 2.21%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000109153              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 700                         | 3 765 268                                     | 1.6%  |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000111720              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 132                           | 140 958                                       | 0.06%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | STARTS                         | XS2257851472              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | IE            | IL          | PLN                | 114                           | 1 129 398                                     | 0.48%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300097              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 119                           | 119 693                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300063              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 119                           | 119 051                                       | 0.05%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                         | PLO266300071              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 24                            | 24 010  | 0.01%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLO144500017              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 082                         | 1 092 996                                     | 0.46%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | WARSZAWA              | PL0135900028              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 86                            | 86 347  | 0.04%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | WARSZAWA              | PL0135900010              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 72                            | 72 348  | 0.03%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000108817              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 183                           | 183 692                                       | 0.08%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA | PL0000111738              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 128                         | 7 162 571                                     | 3.04%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE         | PL0336300010              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8                             | 80 286  | 0.03%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE         | PL0336300028              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8                             | 80 324  | 0.03%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE         | PL0336300036              | N/D                                    | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8                             | 80 359  | 0.03%                                       |                          |
| PKO037                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CBOT (T NOTE 10Y)     |                           | 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                    |                       |                           | N/D                                    | Gotówka/Depozyty/Należności | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 12 051 637                                    | 5.11%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALIOR BANK SA         | PLALIOR00045              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11 190                        | 377 551                                       | 0.44%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA         | LU2237380790              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 46 752                        | 2 695 720                                     | 3.14%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA      | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 032                         | 148 946                                       | 0.17%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK MILLENNIUM       | PLBIG0000016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 503                        | 52 410  | 0.06%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | BANK PEKAO                    | PLPEKAO00016              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 26 026                        | 2 497 455                                     | 2.9%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC0000016              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 5 542                         | 669 474                                       | 0.78%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CD PROJEKT SA                 | PLOPTTC00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11 121                        | 1 876 558                                     | 2.18%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CYFROWY POLSAT SA             | PLCFRPT00013              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 27 892                        | 850 706                                       | 0.99%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                | PLDINPL00011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 007                         | 1 994 192                                     | 2.32%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                       | PLENEA000013              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 141                         | 35 923  | 0.04%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GLOBE TRADE CENTRE SA         | PLGTC0000037              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 622                         | 24 992  | 0.03%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA AZOTY SA                | PLZATRM00012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 947                           | 32 672  | 0.04%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA LOTOS SA                | PLLOTOS00025              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11 051                        | 573 105                                       | 0.67%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ING POLSKA                    | PLBSK0000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 512                           | 101 376                                       | 0.12%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA | PLJSW0000015              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 903                         | 251 890                                       | 0.29%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KERNEL HOLDING SA             | LU0327357389              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | UA            | UA          | PLN                | 883                           | 51 126  | 0.06%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA          | PLKGHM000017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 23 644                        | 4 776 088                                     | 5.55%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | LPP SA                        | PLLPP0000011              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 158                           | 1 769 600                                     | 2.06%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MBANK                         | PLBRE0000012              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 234                         | 373 162                                       | 0.43%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ORANGE POLSKA SA              | PLTLKPL00017              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 85 091                        | 565 855                                       | 0.66%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.              | NL0015000AU7              | N/D                                    | Akcje           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 5 108                         | 224 752                                       | 0.26%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA   | PLPGER000010              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 104 866                       | 1 047 192                                     | 1.22%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKP CARGO SA                    | PLPKPCR00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 597                           | 12 597  | 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                | 44 008                        | 3 599 854                                     | 4.19%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKIE GORNIC'TWO NAFTOWE I GA | PLPGNIG00014              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 246 014                       | 1 620 740                                     | 1.88%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B  | PLPKO0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 130 738                       | 5 317 114                                     | 6.18%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                             | PLPZU0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 86 243                        | 3 196 166                                     | 3.72%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA           | PLBZ00000044              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 4 335                         | 1 157 445                                     | 1.35%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA        | PLTAURN00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 235 297                       | 789 421                                       | 0.92%                                       |                          |
| 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                | 8 920                         | 13 812 330                                    | 16.06%                                      |                          |
| 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                | 22 035                        | 4 440 154                                     | 5.16%                                       |                          |
| 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                | 88 903                        | 13 719 408                                    | 15.96%                                      |                          |
| 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                         | 175 163                                       | 0.2%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKU AZJI I PACYFIKU     | AI0992351938              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| 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                        | 1 632 765                                     | 1.9%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SUROWCOW GLOBALNY               | AI0992351924              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                             | PL0000500286              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 534                           | 540 643                                       | 0.63%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CZECH REPUBLIC                  | CZ0001006076              | N/D                                    | Obligacje                       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 62                            | 94 949  | 0.11%                                       |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | CZECH REPUBLIC                 | CZ0001005888              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | CZ            | CZ          | CZK                | 128                           | 214 783                                       | 0.25%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                 | PLDINPL00045              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 64                            | 64 069  | 0.07%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000112736              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 127                         | 2 991 069                                     | 3.48%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA             | PLECHPS00316              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 32                            | 144 740                                       | 0.17%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ENEA SA                        | PLENEA000096              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2                             | 203 630                                       | 0.24%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BGK                            | PL0000500278              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 308                           | 308 918                                       | 0.36%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO         | PLGHLMC00529              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 38                            | 38 421  | 0.04%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO         | PLGHLMC00511              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 63                            | 64 626  | 0.08%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ         | PLO326300061              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 3 014   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ         | PLO326300079              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 3 017   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ         | PLO326300095              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13                            | 13 096  | 0.02%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEKAO BANK HIPOTECZNY SA       | PLO100600058              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22                            | 220 352                                       | 0.26%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PLO198500012              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22                            | 22 188  | 0.03%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLO037100016              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 101 513                                       | 0.12%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY         | PLPKN0000208              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 101 159                                       | 0.12%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PKO BANK HIPOTECZNY            | PLO219200246              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 499 249                                       | 0.58%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000112728              | N/D                                    | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 560                           | 558 029                                       | 0.65%                                       |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000109153              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 000                         | 2 035 280                                     | 2.37%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | STARTS                   | XS2257851472              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | IE            | IL          | PLN                | 15                            | 148 605                                       | 0.17%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                   | PLO266300097              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16                            | 16 093  | 0.02%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                   | PLO266300063              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16                            | 16 007  | 0.02%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TARNOW                   | PLO266300071              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 3 001   | 0%  |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA | PLO144500017              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 142                           | 143 443                                       | 0.17%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | WARSZAWA                 | PLO135900028              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11                            | 11 044  | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | WARSZAWA                 | PLO135900010              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10                            | 10 048  | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000108817              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 25                            | 25 094  | 0.03%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA    | PL0000111738              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 124                         | 3 139 151                                     | 3.65%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PLO336300010              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 10 036  | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PLO336300028              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 10 040  | 0.01%                                       |                          |
| PKO038                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | MIASTO ZABRZE            | PLO336300036              | N/D                                    | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1                             | 10 045  | 0.01%                                       |                          |
| 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%  |                          |
| 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%  |                          |

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                                    | Gotówka/Depozyty/Należności | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 3 620 613                                     | 4.21%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ALLEGRO.EU SA                   | LU2237380790              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 756                           | 43 591  | 3.08%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ASSECO POLAND SA                | PLSOFTB00016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 137                           | 10 042  | 0.71%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | BANK PEKAO                      | PLPEKAO00016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 431                           | 41 359  | 2.92%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CCC SA                          | PLCCC0000016              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 92                            | 11 114  | 0.79%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CD PROJEKT SA                   | PLOPTTC00011              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 173                           | 29 192  | 2.06%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | CYFROWY POLSAT SA               | PLCFRPT00013              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 673                           | 20 526  | 1.45%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | DINO POLSKA SA                  | PLDINPL00011              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 117                           | 33 298  | 2.35%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | GRUPA LOTOS SA                  | PLLOTOS00025              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 212                           | 10 994  | 0.78%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA   | PLJSW0000015              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 129                           | 4 707   | 0.33%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA            | PLKGHM0000017             | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 334                           | 67 468  | 4.77%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | LPP SA                          | PLLPP0000011              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3                             | 33 600  | 2.38%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | ORANGE POLSKA SA                | PLTLKPL00017              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 583                         | 10 527  | 0.74%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.                | NL0015000AU7              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 72                            | 3 168   | 0.22%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA   | PLPGER0000010             | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 948                         | 19 453  | 1.38%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S  | PLPKN0000018              | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 707                           | 57 833  | 4.09%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GA | PLPGNIG000014             | N/D                                    | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 972                         | 26 168  | 1.85%                                       |                          |



Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2021-05-31



(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                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B | PLPKO0000016              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 097                         | 85 285  | 6.03%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | PZU                            | PLPZU0000011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 390                         | 51 513  | 3.64%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA          | PLBZ00000044              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 81                            | 21 627  | 1.53%                                       |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLTAURN00011              | N/D                                    | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 552                         | 8 562   | 0.61%                                       |                          |
| 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                | 141                           | 218 334                                       | 15.44%                                      |                          |
| 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                | 345                           | 69 519  | 4.91%                                       |                          |
| 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                | 1 418                         | 218 824                                       | 15.47%                                      |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    | AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO        | AI0992351940              | N/D                                    | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 88                            | 11 260  | 0.8%  |                          |
| 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                                    | FX Swap                         | N/D                   |               |             |                    | 0                             | 0   | 0%  |                          |
| PKO076                                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                   | PLN                    |                                |                           | N/D                                    | Gotówka/ Depozyty/ Należności   | N/D                   |               |             | PLN                | 0                             | 298 914                                       | 21.13%                                      |                          |