

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 31/03/2020



Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Kraj ryzyka	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfolio	Wartość instrumentu w walcie wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające		
PKO034	Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020	SFIO	N/D	PLN	OBLIIGACJI DLUGOTERMINOWYCH	AI0992351913	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL		PLN	648 212	159 829 675	9,1%			
		SFIO	N/D	PLN	PAPIEROW DLUZNYCH PLUS	AI0992351923	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL		PLN	719 094	149 848 933	8,0%			
		SFIO	N/D	PLN	SKARBOWY	AI0992351905	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL		PLN	35 291	81 812 118	4,6%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108916	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	20 000	20 614 800	1,2%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108510	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	1 956	1 984 088	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108866	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	78 700	85 209 277	4,8%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000112165	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	40 039	39 210 193	2,2%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000103591	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	13 958	13 958 900	0,6%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109492	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	135 300	141 941 877	8,1%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109427	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	48 800	52 850 888	3,0%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111720	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	44 000	46 663 760	2,6%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111274	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	175 000	173 582 500	9,9%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107611	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	1 000	1 104 670	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107264	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	60 000	67 415 400	3,8%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108197	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	72 000	80 919 360	4,6%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110151	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	138 000	144 753 720	8,2%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111498	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	80 000	88 553 600	5,0%			
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111191	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	102 000	110 175 260	6,3%			
		SFIO	N/D	PLN	US CBOT		N/D		N/D	Kontrakt terminowy	N/D			USD			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	FX Swap	N/D			EUR-PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	FX Swap	N/D			USD-PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	Gotowka/Depozyty	N/D				285 055 634	16,2%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA		PL0000107611	N/D		Obligacje (Reverse Repo)	N/D	PL	PL	PLN		21 973 219	1,2%	

Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030

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 portfolio	Wartość instrumentu w walcie wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające		
PKO035	Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030	SFIO	N/D	PLN	ALIOR BANK SA	PLALIOR00045	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	11 771	151 610	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	BANK MILLENNIUM	PLBIG000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	19 906	64 137	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKA000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	22 446	1 260 118	0,3%			
		SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCC0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	6 049	181 349	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLCDPTC0011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	2 354	2 354 141	0,6%			
		SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRP00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	18 963	451 699	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 229	199 221	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLENEA000013	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	12 262	58 048	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG00022	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	21 608	149 095	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTCT0000037	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	7 208	45 843	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLAZTRM00012	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 885	39 019	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLLOTOS00025	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	10 784	559 258	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK0000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	972	144 634	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	7 012	87 229	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU0327357389	N/D	Akcje	N/D	UA	UA	PLN	1 757	57 981	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGM0000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	28 937	1 731 011	0,4%			
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	174	910 020	0,2%			
		SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE000012	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 743	386 597	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL00017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	86 426	512 938	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER000010	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	113 781	433 164	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 190	12 209	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU1642887738	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	38 009	1 112 904	0,3%			
		SFIO	N/D	PLN	POLSKI CONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKN0000018	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	34 165	1 902 990	0,5%			
		SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GA	PLPKNG000014	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	218 676	752 245	0,2%			
		SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	2 215	2 215 493	0,5%			
		SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	86 865	2 721 480	0,7%			
		SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLB20000044	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	4 727	820 134	0,2%			
		SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURN00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	892 104	997 372	0,2%			
		SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKRUSZ00016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	22 380	1 132 428	0,3%			
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKOW WSHODZACYCH	AI0992351941	N/D		N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL		PLN	2 702	220 793	0,0%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AI0992351940	N/D		N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL		PLN	1 840	164 047	0,0%	
		SFIO	N/D	PLN	OBLIIGACJI DLUGOTERMINOWYCH	AI0992351913	N/D		N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL		PLN	121 374	29 927 185	7,5%	
		SFIO	N/D	PLN	PAPIEROW DLUZNYCH PLUS	AI0992351923	N/D		N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL		PLN	110 611	21 665 380	5,4%	
		SFIO	N/D	PLN	SKARBOWY	AI0992351905	N/D		N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL		PLN	242	560 485	0,1%	
		SFIO	N/D	PLN	STABILNEGO WZROSTU	AI0992351902	N/D		N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL		PLN	664	103 746	0,0%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D		N/D	Tytuly uczestnictwa	N/D	US	US	USD	18 037	19 326 311	4,9%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D		N/D	Tytuly uczestnictwa	N/D	US	EM	USD	57 010	8 068 252	2,0%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UGTS ETF USD	IE0314420688	N/D		N/D	Tytuly uczestnictwa	N/D	IE	US	USD	93 317	10 068 114	2,5%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111498	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	2 500	2 767 300	0,7%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111720	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	16 000	16 968 640	4,3%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108866	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	10 000	10 827 100	2,7%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108197	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	9 000	10 114 920	2,5%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109492	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	24 700	25 912 523	6,5%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110151	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	29 300	29 685 902	7,5%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111191	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	21 000	22 703 730	5,7%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111274	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	32 000	31 740 800	8,0%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109427	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	17 000	18 411 170	4,6%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107264	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	8 000	8 988 720	2,3%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107611	N/D		N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	8 500	9 389 695	2,4%	
		SFIO	N/D	PLN	US CBOT		N/D		N/D	Kontrakt terminowy	N/D			USD			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN	US CME E		N/D		N/D	Kontrakt terminowy	N/D			USD			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	FX Swap	N/D			USD-PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	FX Swap	N/D			EUR-PLN			0,0%	
SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	FX Swap	N/D			JPY-PLN			0,0%			
SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	Gotowka/Depozyty	N/D				98 109 462	24,7%				

Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu
--	-------------------	--------------	---------------------------------------

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 31/03/2020



Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Kraj ryzyka	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w walcie wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające	
		SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCC000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	9 037	270 929	0.1%		
		SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLOPTT00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	11 881	3 434 797	1.6%		
		SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRP00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	26 757	26 757	0.3%		
		SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 796	291 132	0.1%		
		SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLENEA00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	12 803	60 609	0.0%		
		SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG00022	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	31 331	216 184	0.1%		
		SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTCT000037	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	11 201	71 238	0.0%		
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	2 930	60 651	0.0%		
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLLOTOS00025	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	15 732	815 862	0.4%		
		SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 564	232 723	0.1%		
		SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW000015	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	10 171	126 527	0.0%		
		SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU0327357389	N/D	Akcje	N/D	UA	UA	PLN	2 731	90 123	0.0%		
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGM000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	41 972	2 510 765	1.2%		
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	246	1 286 580	0.6%		
		SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE000012	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	2 528	560 710	0.3%		
		SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKP00017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	125 480	744 724	0.3%		
		SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER000010	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	155 064	590 329	0.3%		
		SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 850	18 981	0.0%		
		SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU164287738	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	58 788	1 721 313	0.8%		
		SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKNO000018	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	49 212	2 741 108	1.3%		
		SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GA	PLPGNI000014	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	315 408	1 091 884	0.5%		
		SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	141 428	3 199 101	1.5%		
		SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	127 824	4 004 726	1.9%		
		SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLBZ0000044	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	7 005	1 215 367	0.6%		
		SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURN00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 286 860	1 438 709	0.7%		
		SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKRUSZ00016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	20 340	1 029 204	0.5%		
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI MALYCH I SREDNICH SPOLEK	AIO99235194	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PL	PLN	1 381	349 993	0.2%		
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKOW WSHODZACYCH	AIO99235194	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PL	PLN	2 039	248 368	0.1%		
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AIO99235194	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PL	PLN	34 275	3 055 603	1.4%		
		SFIO	N/D	PLN	OBLIGACJI DLUGOTERMINOWYCH	AIO992351913	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PL	PLN	56 984	14 050 557	6.6%		
		SFIO	N/D	PLN	PAPIEROW DLUGOTERMINUS	AIO992351923	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PL	PLN	39 921	7 819 396	3.7%		
		SFIO	N/D	PLN	SKARBOWY	AIO992351905	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PL	PLN	231	535 458	0.2%		
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D	Tytulny uczestnictwa	N/D	US	US	USD	20 632	22 106 805	10.5%		
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D	Tytulny uczestnictwa	N/D	US	EM	USD	79 095	11 193 798	5.3%		
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF-USD	IE0031442068	N/D	Tytulny uczestnictwa	N/D	IE	US	USD	134 051	14 605 113	6.9%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108866	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	3 500	3 789 485	1.8%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107264	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	2 000	2 247 180	1.1%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107611	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	2 500	2 761 675	1.3%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109492	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	10 100	10 595 809	5.0%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL000011274	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	3 000	2 975 700	1.4%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110151	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	9 800	10 279 612	4.9%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111191	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	7 800	8 432 814	4.0%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109427	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	4 700	5 090 147	2.4%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111498	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	8 000	8 855 360	4.2%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108197	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	6 000	6 743 280	3.2%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111720	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	5 000	5 302 700	2.5%		
		SFIO	N/D	PLN	PL WSIE F	N/D	N/D	Kontrakt terminowy	N/D	PLN	PLN	PLN				0.0%	
		SFIO	N/D	PLN	US CBT	N/D	N/D	Kontrakt terminowy	N/D	USD	USD	USD				0.0%	
		SFIO	N/D	PLN	US CME E	N/D	N/D	Kontrakt terminowy	N/D	USD	USD	USD				0.0%	
		SFIO	N/D	PLN		N/D	N/D	FX Swap	N/D	EUR	PLN	EUR				0.0%	
		SFIO	N/D	PLN		N/D	N/D	FX Swap	N/D	USD	PLN	USD				0.0%	
		SFIO	N/D	PLN		N/D	N/D	FX Swap	N/D	JPY	PLN	JPY				0.0%	
		SFIO	N/D	PLN		N/D	N/D	Gotowka/Depozyty	N/D							18.6%	

Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Kraj ryzyka	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w walcie wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające
		SFIO	N/D	PLN	ALIOR BANK SA	PLALIOR00045	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	11 496	148 068	0.1%	
		SFIO	N/D	PLN	BANK MILLENNIUM	PLBIG000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	23 903	77 015	0.1%	
		SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKA000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	22 296	1 251 697	1.3%	
		SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCC000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	5 232	156 855	0.2%	
		SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLOPTT00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	8 626	2 493 777	2.6%	
		SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRP00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	20 736	493 932	0.5%	
		SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 584	256 766	0.3%	
		SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLENEA00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	7 822	37 029	0.0%	
		SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG00022	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	20 676	142 664	0.1%	
		SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTCT000037	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	6 842	43 515	0.0%	
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 789	37 032	0.0%	
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLLOTOS00025	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	11 725	608 058	0.6%	
		SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 167	173 650	0.2%	
		SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW000015	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	7 149	88 934	0.1%	
		SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU0327357389	N/D	Akcje	N/D	UA	UA	PLN	1 667	55 011	0.0%	
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGM000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	29 483	1 763 673	1.8%	
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	173	904 790	0.9%	
		SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE000012	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 775	393 695	0.4%	
		SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKP00017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	88 206	523 503	0.5%	
		SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER000010	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	108 913	414 632	0.4%	
		SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 129	11 584	0.0%	
		SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU164287738	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	38 870	1 138 114	1.2%	
		SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKNO000018	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	35 182	1 959 637	2.0%	
		SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GA	PLPGNI000014	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	222 837	766 559	0.8%	
		SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	100 430	2 271 727	2.3%	
		SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	68 786	2 155 065	2.2%	
		SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLBZ0000044	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	7 442	770 887	0.8%	
		SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURN00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	960 543	1 073 887	1.1%	
		SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKRUSZ00016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	12 180	616 308	0.6%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKOW WSHODZACYCH	AIO99235194	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PL	PLN	2 654	216 857	0.2%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AIO99235194	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PL	PLN	1 962 260	2 000 000	2.0%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D	Tytulny uczestnictwa	N/D	US	US	USD	12 698	13 605 671	14.1%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D	Tytulny uczestnictwa	N/D	US	EM	USD	53 507	5 752 496	7.8%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF-USD	IE0031442068	N/D	Tytulny uczestnictwa	N/D	IE	US	USD	10 216	10 216 421	10.1%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107264	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	1 400	1 573 026	1	

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 31/03/2020



Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Kraj ryzyka	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w walucie wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109427	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	1 000	1 083 010	1,1%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110151	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	3 000	3 146 820	3,2%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108197	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	2 000	2 247 760	2,3%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111720	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	1 000	1 060 540	1,1%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111191	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	2 500	2 702 825	2,8%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108866	N/D	Obligacje	N/D	PL	PL	PLN	2 000	2 165 420	2,2%	
		SFIO	N/D	PLN	PL WSE F		N/D	Kontrakt terminowy	N/D			PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN	US CBOT		N/D	Kontrakt terminowy	N/D			USD			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN	US CME E		N/D	Kontrakt terminowy	N/D			USD			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D			USD:PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D			EUR:PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D			JPY:PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D					19 413 035	20,1%	

Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	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	ALIOR BANK SA	PLALIOR00045	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	5 951	76 649	0,2%			
		SFIO	N/D	PLN	BANK MILLENNIUM	PLRIG000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	10 503	33 841	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKAO00016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	11 997	673 512	1,9%			
		SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCC000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	2 993	89 730	0,2%			
		SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	4 380	1 266 258	3,6%			
		SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRP00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	11 663	277 813	0,8%			
		SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	1 479	239 746	0,7%			
		SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLENEA00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	4 141	19 603	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG00022	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	8 333	57 498	0,2%			
		SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTCC000037	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	3 622	23 036	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	947	19 603	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLLOTOS00025	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	5 950	308 567	0,9%			
		SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	512	76 186	0,2%			
		SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSRW000015	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	3 800	47 272	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU0327357389	N/D	Akcje	N/D	UA	UA	PLN	883	29 139	0,1%			
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	13 981	836 343	2,4%			
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	90	470 700	1,3%			
		SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE000012	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	942	208 936	0,6%			
		SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL00017	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	46 926	278 506	0,8%			
		SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER000010	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	57 893	220 399	0,6%			
		SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPC00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	597	6 125	0,0%			
		SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU1642887738	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	11 463	335 637	1,0%			
		SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKNO000018	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	18 819	1 048 218	3,0%			
		SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICZTWO NAFTOWE I GA	PLPGNI000014	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	118 452	407 475	1,2%			
		SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	52 778	1 193 838	3,4%			
		SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	44 159	1 383 501	4,0%			
		SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLSZ0000044	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	2 378	412 583	1,2%			
		SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURON00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	413 666	462 479	1,3%			
		SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKRUSZ00016	N/D	Akcje	N/D	PL	PL	PLN	5 100	258 060	0,7%			
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKOW WSCHDZACYCH	AI0992351941	N/D		N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL		PLN	1 323	108 147	0,3%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AI0992351940	N/D		N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	US		PLN	7 185	604 574	1,8%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D		N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	US	US	USD	5 828	6 244 594	18,0%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D		N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	US	EM	USD	27 480	3 889 065	11,2%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD	IE0031442068	N/D		N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	IE	US	USD	59 795	6 514 780	18,8%	
		SFIO	N/D	PLN	PL WSE F		N/D		N/D	Kontrakt terminowy	N/D			PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN	US CME E		N/D		N/D	Kontrakt terminowy	N/D			USD			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	FX Swap	N/D			EUR:PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	FX Swap	N/D			USD:PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	FX Swap	N/D			JPY:PLN			0,0%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D		N/D	Gotowka/Depozyty	N/D					6 429 298	18,6%	