

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 31/05/2019



Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluacie wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające	
PKO034	Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020	SFIO	N/D	PLN	OBLIGACJI DŁUGOTERMINOWYCH	A10992351913	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	709 442	170 131 204	12,02%		
		SFIO	N/D	PLN	PAPIEROWY DŁUŻNYCH PLUS	A10992351923	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	719 094	138 404 013	9,78%		
		SFIO	N/D	PLN	SKARBOWY	A10992351905	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	35 291	82 076 096	5,80%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108197	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	81 000	87 825 060	6,23%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109427	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	62 800	64 069 188	4,53%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109492	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	65 300	66 316 068	4,69%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111191	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	100 000	102 153 000	7,22%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107264	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	50 000	55 366 500	3,91%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108510	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	60 000	60 110 400	4,25%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108866	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	97 700	100 397 497	7,09%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110151	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	98 000	100 930 200	7,13%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL000011274	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	15 000	14 532 000	1,03%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000105391	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	10 000	12 857 800	0,91%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108916	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	20 000	20 179 800	1,43%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107611	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	1 000	1 016 610	0,07%		
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111498	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	80 000	82 098 400	5,80%		
		SFIO	N/D	PLN	EUREX	DE0009652644	N/D	Kontrakt terminowy	N/D	EUR	EUR		90 385	0,00%		
		SFIO	N/D	PLN						FX Swap	N/D	USD/PLN		-49 132	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN						FX Swap	N/D	EUR/PLN		100 977	0,01%	
		SFIO	N/D	PLN						Gotówka/Depozyty	N/D	EUR		3 568 508	0,25%	
		SFIO	N/D	PLN						Gotówka/Depozyty	N/D	USD		53 008	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN						Gotówka/Depozyty	N/D	USD		1 197 813	0,08%	
		SFIO	N/D	PLN						Gotówka/Depozyty	N/D	PLN		25 777 776	1,82%	
		SFIO	N/D	PLN						Gotówka/Depozyty	N/D	EUR		52 314	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN						Gotówka/Depozyty	N/D	PLN		125 136 390	8,84%	
		SFIO	N/D	PLN						Transakcje z przyrzeczeniem odkupu	N/D	PL	PLN	101 128 626	7,15%	

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	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluacie wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające
PKO035	Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030	SFIO	N/D	PLN	ALIOR BANK SA	PLALIOR000045	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	20 943	1 105 790	0,43%	
		SFIO	N/D	PLN	ASSECO POLAND SA	PLASOFTB00016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	8 675	443 292	0,17%	
		SFIO	N/D	PLN	BANK MILENNIUM	PLBIC0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	38 453	367 995	0,14%	
		SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKA000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	40 128	4 263 600	1,67%	
		SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCC0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	11 118	1 742 191	0,68%	
		SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLCDPT000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	14 369	2 985 878	1,17%	
		SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	31 120	812 232	0,32%	
		SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 407	175 031	0,07%	
		SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLENEA000013	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	23 686	199 199	0,08%	
		SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG000022	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	41 740	323 068	0,13%	
		SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTCT0000037	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	13 923	116 814	0,05%	
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOITY SA	PLAZTRM000012	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	3 641	145 130	0,06%	
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLLOTOS000025	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	19 084	1 675 957	0,66%	
		SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK0000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 877	356 255	0,14%	
		SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	12 481	626 546	0,25%	
		SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU0327357389	N/D	Akcje	N/D	UA	PLN	3 394	157 821	0,06%	
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM0000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	53 142	5 048 490	1,98%	
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	317	2 325 195	0,91%	
		SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE0000012	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	3 105	1 250 073	0,46%	
		SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	153 871	792 436	0,31%	
		SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER000010	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	203 692	1 880 077	0,74%	
		SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	2 298	98 699	0,04%	
		SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU1642887738	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	71 574	1 876 670	0,74%	
		SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKNO000018	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	60 156	5 821 898	2,28%	
		SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GA	PLPGNI000014	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	389 593	2 181 721	0,85%	
		SFIO	N/D	PLN	POWZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	172 683	6 786 442	2,66%	
		SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZ0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	156 316	6 476 172	2,54%	
		SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLBZ00000044	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	8 461	3 089 957	1,21%	
		SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURN00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 401 749	2 224 576	0,87%	
		SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKRZ0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	22 380	935 484	0,37%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH	A10992351941	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	2 702	270 938	0,11%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	A10992351940	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	35 840	3 442 444	1,35%	
		SFIO	N/D	PLN	OBLIGACJI DŁUGOTERMINOWYCH	A10992351913	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	121 374	29 106 697	11,40%	
		SFIO	N/D	PLN	PAPIEROWY DŁUŻNYCH PLUS	A10992351923	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	110 611	21 289 307	8,34%	
		SFIO	N/D	PLN	SKARBOWY	A10992351905	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	242	562 294	0,22%	
		SFIO	N/D	PLN	STABILNEGO WZROSTU	A10992351902	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	664	113 523	0,04%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	US	USD	353	376 845	0,15%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD	IE00B0M63177	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	IE	USD	32 396	4 814 119	1,89%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	US	USD	37 603	5 893 344	2,31%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD	IE0031442068	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	IE	USD	232 663	24 743 879	9,69%	
		SFIO	N/D	PLN	LYXOR EUR STOXX BNK DR-C-EUR	LU1829219390	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	FR	EUR	15 216	5 219 508	2,04%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107611	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	8 500	8 641 185	3,38%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108197	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	9 000	9 758 340	3,82%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109427	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	17 000	17 343 570	6,79%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111498	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	2 500	2 565 575	1,00%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111191	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	10 000	10 215 300	4,00%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110151	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	10 700	11 019 930	4,32%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108866	N/D	Dłużne papiery wartościowe	N/D	PL	PLN	10 000	10 276 100	4,02%	
		SFIO	N/D	PLN	EUREX DE E		N/D	Kontrakt terminowy	N/D	EUR	EUR		17 614 177	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN	US CME E		N/D	Kontrakt terminowy	N/D	USD	USD		1 589 315	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	USD/PLN	USD/PLN		-293 398	0,00%			
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	EUR/PLN	EUR/PLN		16 303	0,01%			
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	JPY/PLN	JPY/PLN		-2 456	0,00%			
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotówka/Depozyty	N/D	PLN	PLN		28 588 656	11,20%			
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotówka/Depozyty	N/D	USD	USD		1 944 991	0,76%			
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotówka/Depozyty	N/D	JPY	JPY		354	0,00%			
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotówka/Depozyty	N/D	EUR	EUR		52 462	0,02%			
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotówka/Depozyty	N/D	USD	USD		1 459 753	0,57%			

Sklad portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzien 31/05/2019



Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilosc instrumentow w portfelu	Wartosc instrumentu w waluacie wyceny funduszu	Procentowy udzial w wartosci aktywow ogolem	Informacje uzupelniajace
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	PL	PLN		1 306 910	0,51%	
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM000017	N/D	Pozyczki papierow wartosciowych	N/D	PL	PLN		-581 747	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP0000011	N/D	Pozyczki papierow wartosciowych	N/D	PL	PLN		-2 573 637	0,00%	

Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilosc instrumentow w portfelu	Wartosc instrumentu w waluacie wyceny funduszu	Procentowy udzial w wartosci aktywow ogolem	Informacje uzupelniajace
		SFIO	N/D	PLN	ALIOR BANK SA	PLALIOR000045	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	19 436	1 026 221	0,68%	
		SFIO	N/D	PLN	ASSECO POLAND SA	PLSOFTB00016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	8 332	425 765	0,28%	
		SFIO	N/D	PLN	BANK MILLENNIUM	PLBIG0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	39 838	381 250	0,25%	
		SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKA000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	38 610	4 102 312	2,73%	
		SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCC0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	10 669	1 671 832	1,11%	
		SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLOPTT00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	13 411	2 786 806	1,86%	
		SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	27 756	724 432	0,48%	
		SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 265	157 366	0,10%	
		SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLNEA000013	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	15 918	133 870	0,09%	
		SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG00022	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	38 953	301 496	0,20%	
		SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTCC000037	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	13 926	1 116 839	0,08%	
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	3 643	145 210	0,10%	
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLGTOS000025	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	17 811	1 564 162	1,04%	
		SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK0000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 944	368 971	0,25%	
		SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJASW000015	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	11 583	581 467	0,39%	
		SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU032737389	N/D	Akcje	N/D	UA	PLN	3 395	157 867	0,11%	
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	49 428	4 695 660	3,13%	
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	286	2 097 810	1,40%	
		SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE0000012	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	2 881	1 159 891	0,77%	
		SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL00017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	142 931	736 095	0,49%	
		SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER000010	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	176 694	1 630 886	1,09%	
		SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	2 300	98 785	0,07%	
		SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU1642887738	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	71 242	1 867 965	1,24%	
		SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKN0000018	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	55 346	5 356 386	3,57%	
		SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GA	PLPGOR000014	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	361 812	2 026 147	1,35%	
		SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	159 322	6 261 355	4,17%	
		SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	147 443	6 108 563	4,07%	
		SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLBZ0000044	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	8 039	2 935 843	1,96%	
		SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURON00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 327 429	2 106 630	1,40%	
		SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKRUSZ00016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	20 340	850 212	0,57%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI MALYCH I SREDNICH SPOLEK	AI0992351914	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	1 381	426 604	0,28%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH	AI0992351941	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	3 039	304 777	0,20%	
		SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AI0992351940	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	34 275	3 292 099	2,19%	
		SFIO	N/D	PLN	OBLIGACJI DLUGOTERMINOWYCH	AI0992351913	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	56 984	13 665 345	9,10%	
		SFIO	N/D	PLN	PAPIEROW DLUZNYCH PLUS	AI0992351923	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	39 921	7 683 664	5,12%	
		SFIO	N/D	PLN	SKARBOWY	AI0992351905	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	PL	PLN	231	537 186	0,36%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D	Tytuly uczestnictwa	N/D	US	USD	312	333 075	0,22%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD	IE00B0M63177	N/D	Tytuly uczestnictwa	N/D	IE	USD	31 325	4 654 966	3,10%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D	Tytuly uczestnictwa	N/D	US	USD	32 122	5 034 332	3,35%	
		SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD	IE0031442068	N/D	Tytuly uczestnictwa	N/D	IE	USD	202 432	21 528 790	14,34%	
		SFIO	N/D	PLN	LYXOR EUR STOXX BNK DR-C-EUR	LU1829219390	N/D	Tytuly uczestnictwa	N/D	FR	EUR	14 544	4 988 993	3,32%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PLRZCZ0000866	N/D	Dluzne papiery wartosciowe	N/D	PL	PLN	3 500	3 596 635	2,40%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000109427	N/D	Dluzne papiery wartosciowe	N/D	PL	PLN	4 700	4 794 987	3,19%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000108197	N/D	Dluzne papiery wartosciowe	N/D	PL	PLN	3 000	3 252 780	2,17%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111191	N/D	Dluzne papiery wartosciowe	N/D	PL	PLN	2 800	2 860 284	1,91%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000110151	N/D	Dluzne papiery wartosciowe	N/D	PL	PLN	4 000	4 119 600	2,74%	
		SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000107611	N/D	Dluzne papiery wartosciowe	N/D	PL	PLN	2 500	2 541 525	1,69%	
		SFIO	N/D	PLN	EUREX DE E		N/D	Kontrakt terminowy	N/D		EUR		15 097 866	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D		JPY/PLN		-2 456	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D		EUR/PLN		11 521	0,01%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D		USD/PLN		-256 135	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		USD		1 608 119	1,07%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		JPY		354	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		PLN		9 882 811	6,58%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		PLN		1 207 537	0,80%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		USD		1 186 853	0,79%	
		SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D		EUR		50 163	0,03%	
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM000017	N/D	Pozyczki papierow wartosciowych	N/D	PL	PLN		-581 747	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP0000011	N/D	Pozyczki papierow wartosciowych	N/D	PL	PLN		-2 341 360	0,00%	
		SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL00017	N/D	Pozyczki papierow wartosciowych	N/D	PL	PLN		-386 027	0,00%	

Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilosc instrumentow w portfelu	Wartosc instrumentu w waluacie wyceny funduszu	Procentowy udzial w wartosci aktywow ogolem	Informacje uzupelniajace
		SFIO	N/D	PLN	ALIOR BANK SA	PLALIOR000045	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	10 057	531 010	0,85%	
		SFIO	N/D	PLN	ASSECO POLAND SA	PLSOFTB00016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	4 235	216 408	0,35%	
		SFIO	N/D	PLN	BANK MILLENNIUM	PLBIG0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	23 903	228 752	0,37%	
		SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKA000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	18 778	1 995 162	3,19%	
		SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCC0000016	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	4 612	722 700	1,15%	
		SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLOPTT00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN		1 484 315	2,37%	
		SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	14 733	384 531	0,57%	
		SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	528	65 683	0,10%	
		SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLNEA000013	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	7 822	65 783	0,11%	
		SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG00022	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	20 676	160 032	0,26%	
		SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTCC000037	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	6 842	57 404	0,09%	
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 789	71 310	0,11%	
		SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLGTOS000025	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	9 821	862 480	1,38%	
		SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK0000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	1 167	221 497	0,35%	
		SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJASW000015	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	5 900	3 900 698	0,48%	
		SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU032737389	N/D	Akcje	N/D	UA	PLN	1 667	77 515	0,12%	
		SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM000017	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	26 482	2 515 790	4,02%	
		SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP0000011	N/D	Akcje	N/D	PL	PLN	149	1 092 915	1,75%	

Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 31/05/2019



Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluście wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające
SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE0000012	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		1 489	599 471	0,96%	
SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL00017	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		73 964	380 915	0,61%	
SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER00010	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		91 383	843 465	1,35%	
SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		1 129	48 491	0,08%	
SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU1642887738	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		36 858	966 417	1,54%	
SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKN0000018	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		28 822	2 789 393	4,46%	
SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GA	PLPGNI000014	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		187 097	1 047 743	1,67%	
SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO0000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		82 447	3 240 167	5,18%	
SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU0000011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		56 281	2 331 722	3,73%	
SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLBZ0000044	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		3 709	1 354 527	2,16%	
SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURN00011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		733 283	1 163 879	1,86%	
SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKKRUSZ00016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		12 180	509 124	0,81%	
SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH	AI0992351941	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	N/D	PL	PLN		2 654	266 110	0,43%	
SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AI0992351940	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	N/D	PL	PLN		22 011	2 114 135	3,38%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	US	USD			544	580 747	0,93%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD	IE00B0M63177	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	IE	USD			16 625	2 470 513	3,95%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	US	USD			16 410	2 371 863	4,11%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD	IE0031442068	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	IE	USD			105 304	11 199 157	17,89%	
SFIO	N/D	PLN	LYXOR EUR STOXX BNK DR-C-EUR	LU1829219390	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	FR	EUR			7 272	2 494 497	3,99%	
SFIO	N/D	PLN	EUREX DE E		N/D	Kontrakt terminowy	N/D	EUR	EUR				7 548 933	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	US CME E		N/D	Kontrakt terminowy	N/D	USD	USD				1 059 543	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	USD/PLN					-134 225	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	EUR/PLN					3 830	0,01%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	JPY/PLN					-824	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	PLN					811 680	1,30%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	USD					784 529	1,25%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	USD					496 683	0,79%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	PLN					6 340 597	10,13%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	EUR					64 132	0,10%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	JPY					354	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCC0000016	N/D	Pożyczki papierów wartościowych	N/D	PL	PLN				-844 653	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP0000011	N/D	Pożyczki papierów wartościowych	N/D	PL	PLN				-1 254 300	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL00017	N/D	Pożyczki papierów wartościowych	N/D	PL	PLN				-392 188	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111191	N/D	Transakcje z przyrzeczeniem odkupu	N/D	PL	PLN				6 061 195	9,69%	

Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060

Identyfikator funduszu lub subfunduszu	Nazwa subfunduszu	Typ funduszu	Standardowy identyfikator subfunduszu	Waluta wyceny funduszu	Nazwa emitenta	Identyfikator instrumentu	Alternatywny identyfikator instrumentu	Typ instrumentu	Kategoria instrumentu	Kraj emitenta	Waluta instrumentu	Ilość instrumentów w portfelu	Wartość instrumentu w waluście wyceny funduszu	Procentowy udział w wartości aktywów ogółem	Informacje uzupełniające
SFIO	N/D	PLN	ALIOR BANK SA	PLALIOR000045	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		4 059	214 315	0,83%	
SFIO	N/D	PLN	ASSECO POLAND SA	PLSORBT00016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		2 148	109 763	0,43%	
SFIO	N/D	PLN	BANK MILLENNIUM	PLBGM000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		10 503	100 514	0,39%	
SFIO	N/D	PLN	BANK PEKAO	PLPEKA000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		7 795	828 219	3,22%	
SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCC0000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		1 884	295 223	1,15%	
SFIO	N/D	PLN	CD PROJEKT SA	PLOPTT00011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		2 610	542 358	2,11%	
SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		4 493	117 267	0,46%	
SFIO	N/D	PLN	DINO POLSKA SA	PLDINPL00011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		219	27 244	0,11%	
SFIO	N/D	PLN	ENEA SA	PLENEA000013	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		4 141	34 826	0,14%	
SFIO	N/D	PLN	ENERGA SA	PLENERG000022	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		8 333	64 497	0,25%	
SFIO	N/D	PLN	GLOBE TRADE CENTRE SA	PLGTC000037	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		3 622	30 389	0,12%	
SFIO	N/D	PLN	GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		947	37 747	0,15%	
SFIO	N/D	PLN	GRUPA LOTOS SA	PLLOTOS00025	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		3 677	322 914	1,26%	
SFIO	N/D	PLN	ING POLSKA	PLBSK0000017	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		512	97 178	0,38%	
SFIO	N/D	PLN	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW000015	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		2 417	121 333	0,47%	
SFIO	N/D	PLN	KERNEL HOLDING SA	LU0327357389	N/D	Akcje	N/D	UA	PLN			883	41 059	0,16%	
SFIO	N/D	PLN	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLKGHM000017	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		10 397	987 715	3,84%	
SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP0000011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		57	418 095	1,63%	
SFIO	N/D	PLN	MBANK	PLBRE0000012	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		601	241 963	0,94%	
SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL00017	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		29 915	154 062	0,60%	
SFIO	N/D	PLN	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA	PLPGER00010	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		36 956	341 104	1,33%	
SFIO	N/D	PLN	PKP CARGO SA	PLPKPCR00011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		597	25 641	0,10%	
SFIO	N/D	PLN	PLAY COMMUNICATIONS SA	LU1642887738	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		9 067	237 737	0,92%	
SFIO	N/D	PLN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S	PLPKN0000018	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		11 224	1 086 259	4,22%	
SFIO	N/D	PLN	POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GA	PLPGNI000014	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		75 764	424 278	1,65%	
SFIO	N/D	PLN	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B	PLPKO0000016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		32 489	1 276 818	4,96%	
SFIO	N/D	PLN	PZU	PLPZU0000011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		12 180	509 124	1,86%	
SFIO	N/D	PLN	SANTANDER BANK POLSKA	PLBZ0000044	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		1 506	549 991	2,14%	
SFIO	N/D	PLN	TAURON POLSKA ENERGIA SA	PLTAURN00011	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		368 168	584 283	2,27%	
SFIO	N/D	PLN	ZAKLADY TLUSZCZOWE KRUSZWICA S	PLKKRUSZ00016	N/D	Akcje	N/D	N/D	PL	PLN		5 100	213 180	0,83%	
SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH	AI0992351941	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	N/D	PL	PLN		1 323	132 709	0,52%	
SFIO	N/D	PLN	AKCJI RYNKU JAPONSKIEGO	AI0992351940	N/D	Jednostki uczestnictwa	N/D	N/D	PL	PLN		7 185	690 153	2,68%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES CORE S&P 500 ETF	US4642872000	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	US	USD			142	151 592	0,59%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD	IE00B0M63177	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	IE	USD			6 810	1 011 982	3,93%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	US4642872349	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	US	USD			7 087	1 110 713	4,33%	
SFIO	N/D	PLN	ISHARES S&P 500 UCITS ETF USD	IE0031442068	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	IE	USD			43 235	4 598 074	17,88%	
SFIO	N/D	PLN	LYXOR EUR STOXX BNK DR-C-EUR	LU1829219390	N/D	Tytuły uczestnictwa	N/D	FR	EUR			2 968	1 018 106	3,96%	
SFIO	N/D	PLN	EUREX DE E		N/D	Kontrakt terminowy	N/D	EUR	EUR				3 774 467	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	US CME E		N/D	Kontrakt terminowy	N/D	USD	USD				529 772	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	EUR/PLN					2 001	0,01%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	JPY/PLN					-498	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	FX Swap	N/D	USD/PLN					-55 771	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	JPY					354	0,00%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	PLN					2 512 374	9,77%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	USD					370 184	1,44%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	USD					313 680	1,22%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	EUR					46 189	0,18%	
SFIO	N/D	PLN			N/D	Gotowka/Depozyty	N/D	PLN					502 079	1,95%	
SFIO	N/D	PLN	CCC SA	PLCCC0000016	N/D	Pożyczki papierów wartościowych	N/D	PL	PLN				-344 576	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	N/D	Pożyczki papierów wartościowych	N/D	PL	PLN				-47 652	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	LPP SA	PLLPP0000011	N/D	Pożyczki papierów wartościowych	N/D	PL	PLN				-483 138	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	ORANGE POLSKA SA	PLTLKPL00017	N/D	Pożyczki papierów wartościowych	N/D	PL	PLN				-158 622	0,00%	
SFIO	N/D	PLN	RZECZPOSPOLITA POLSKA	PL0000111191	N/D	Transakcje z przyrzeczeniem odkupu	N/D	PL	PLN				2 525 498	9,82%	