

Roczna struktura aktywów

Data wyceny: 2017-12-29

Lp.	Kategoria lokaty	Wartość	Udział w wartości aktywów (%)
5.	Depozyty bankowe w walucie polskiej w bankach lub instytucjach kredytowych, mających siedzibę i prowadzących działalność na podstawie zezwolenia właściwych organów nadzoru nad rynkiem finansowym w państwach, o których mowa w ust. 4	1 736 004 421,42	12,17
	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
	Depozyt: P000048101 - BGŻBANK - 2018-01-02	300 000 000,00	2,10
	Depozyt: P000044297 - PEKAOBANK - 2018-01-12	300 000 000,00	2,11
	Depozyt: P000041801 - MILLENNIUMBANK - 2018-01-10	300 000 000,00	2,10
	Depozyt: P000048364 - DEUTSCHEBANK - 2018-01-02	16 004 421,42	0,11
	Depozyt: P000041290 - BZWBKBANK - 2018-02-21	100 000 000,00	0,70
	Depozyt: P000041299 - RAIFFEISEN - 2018-02-21	100 000 000,00	0,70
	Depozyt: P000045363 - BZWBKBANK - 2018-03-02	50 000 000,00	0,35
	Depozyt: P000030168 - BZWBKBANK - 2018-01-26	50 000 000,00	0,35
	Depozyt: P000048363 - DEUTSCHEBANK - 2018-01-02	520 000 000,00	3,65
7.	Akcje spółek notowanych na rynku regulowanym na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej oraz obligacje zamienne na akcje tych spółek, a także notowane na tym rynku prawa poboru i prawa do akcji	10 922 532 552,37	76,57
	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
	ALIOR BANK S.A.	368 444 385,38	2,58
	AMREST HOLDINGS SE	108 343 570,92	0,76
	ASSECO BUSINESS SOLUTIONS S.A.	122 128 800,00	0,86
	ASSECO POLAND S.A.	140 075 371,05	0,98
	ASSECO SOUTH EASTERN EUROPE S.A.	28 216 571,46	0,20
	ASTARTA HOLDING N.V.	43 310 102,58	0,30
	ATM GRUPA S.A.	23 311 729,71	0,16
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE S.A.	133 825 437,57	0,94
	BANK MILLENNIUM S.A.	105 241 338,18	0,74
	BANK POLSKA KASA OPIEKI S.A.	346 027 574,97	2,43
	BANK ZACHODNI WBK S.A.	598 358 835,03	4,19
	BENEFIT SYSTEMS S.A.	266 518 059,52	1,87
	BUDIMEX S.A.	149 998 917,51	1,05
	CAPITAL PARK S.A.	67 834 009,08	0,48
	CCC S.A.	250 853 886,15	1,76
	CD PROJEKT S.A.	262 557 387,44	1,84
	CELON PHARMA S.A.	50 145 480,00	0,35
	CERAMIKA NOWA GALA S.A.	15 306 666,82	0,11
	CEZ A.S.	75 956 488,09	0,53
	CIECH S.A.	19 617 391,80	0,14
	COMARCH S.A.	219 114 576,09	1,54
	COMP S.A.	51 492 158,62	0,36
	CYFROWY POLSAT S.A.	133 579 856,55	0,94
	DINO POLSKA S.A.	24 152 100,00	0,17
	ECHO INVESTMENT S.A.	51 874 541,37	0,36
	ELEKTROBUDOWA S.A.	20 831 521,02	0,15
	ELEMENTAL HOLDING S.A.	29 764 931,84	0,21
	EMPERIA HOLDING S.A.	49 780 053,54	0,35
	ENEA S.A.	69 044 353,65	0,48
	ENERGA S.A.	26 105 154,75	0,18
	ENERGOINSTAL S.A.	6 752,88	0,00
	ERBUD S.A.	2 403 672,72	0,02
	ES-SYSTEM S.A.	2 472 121,60	0,02
	EUROCASH S.A.	77 806 925,44	0,55
	FABRYKA FARB I LAKIERÓW ŚNIEŻKA S.A.	42 048 559,33	0,29
	FABRYKI MEBLI FORTE S.A.	40 869 802,20	0,29
	FAMUR S.A.	68 160 188,80	0,48
	FERRO S.A.	12 408 790,96	0,09
	GETBACK S.A.	47 369 800,95	0,33
	GETIN HOLDING S.A.	180 008,58	0,00
	GLOBE TRADE CENTRE S.A.	391 617,45	0,00
	GRUPA AZOTY S.A.	59 859 412,44	0,42
	GRUPA KĘTY S.A.	190 581 974,64	1,34
	GRUPA LOTOS S.A.	20 552 421,40	0,14
	IDEA BANK S.A.	37 041 450,00	0,26
	INDUSTRIAL MILK COMPANY S.A.	18 080 138,16	0,13
	ING BANK ŚLĄSKA S.A.	278 270 671,96	1,95
	INTER CARS S.A.	145 051 227,54	1,02
	INTROL S.A.	6 635 422,78	0,05
	IZOSTAL S.A.	2 605 000,00	0,02
	JASTRZĘBSKA SPÓŁKA WĘGLOWA S.A.	32 151 743,20	0,22
	KERNEL HOLDING S.A.	533 829,83	0,00
	KGHM POLSKA MIEDŹ S.A.	426 423 423,36	2,99
	KRUK S.A.	4 772 590,62	0,03
	LC CORP S.A.	21 368 652,25	0,15
	LIVECHAT SOFTWARE S.A.	38 754 932,11	0,27
	LPP S.A.	125 641 627,05	0,88
	LUBELSKI WĘGIEL BOGDANKA S.A.	15 351 227,43	0,11
	MABION S.A.	10 690 067,94	0,07
	MANGATA HOLDING S.A.	182 290,56	0,00
	MBANK S.A.	215 676 481,47	1,51
	MENNICA POLSKA S.A.	106 638 120,00	0,75
	MLP GROUP S.A.	57 100 327,20	0,40
	MOL MAGYAR OLAJ- ES GAZIPARI RT.	204 697 917,55	1,43
	NEWAG S.A.	47 360 930,58	0,33
	OPEN FINANCE S.A.	5 848 909,84	0,04
	OPONEO.PL S.A.	6 552 740,25	0,05
	ORANGE POLSKA S.A.	166 719 580,02	1,17
	ORBIS S.A.	269 466 000,00	1,89
	OT LOGISTICS S.A.	45 772 927,20	0,32

P.A.NOVA S.A.	20 240 000,00	0,14	
PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA S.A.	265 102 847,64	1,86	
PKP CARGO S.A.	149 063 123,85	1,04	
PLAY COMMUNICATIONS S.A.	44 005 000,00	0,31	
POLSKI HOLDING NIERUCHOMOŚCI S.A.	18 644 513,58	0,13	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S.A.	1 090 945 373,80	7,65	
POLSKIE GÓRNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO S.A.	270 261 425,00	1,89	
POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI S.A.	1 352 392 716,36	9,48	
POWSZECHNY ZAKŁAD UBEZPIECZEŃ S.A.	664 158 763,52	4,66	
PRÓCHNIK S.A.	1 561 115,10	0,01	
PZ CORMAY S.A.	1 942 850,14	0,01	
RADPOL S.A.	1 828 258,20	0,01	
RAWLPLUG S.A.	1 643 500,00	0,01	
ROBYG S.A.	17 961 807,68	0,13	
RONSON EUROPE N.V.	18 437 000,26	0,13	
SANOK RUBBER COMPANY S.A.	42 458 034,96	0,30	
SECO/WARWICK S.A.	11 213 965,00	0,08	
SKARBIEC HOLDING S.A.	13 900 624,66	0,10	
SOHO DEVELOPMENT S.A.	1 764 908,88	0,01	
SOLAR COMPANY S.A.	888 000,00	0,01	
STELMET S.A.	3 507 075,00	0,02	
SYNEKTIK S.A.	2 923 606,84	0,02	
TAURON POLSKA ENERGIA S.A.	831 919,14	0,01	
UNICREDIT S.P.A.	9 036 091,38	0,06	
WARIMPEX FINANZ- UND BETEILIGUNGS AG	30 789 496,98	0,22	
WARIMPEX FINANZ- UND BETEILIGUNGS AG - AT0000A100Y0 - 2018-11-03	22 218 370,98	0,16	
WAWEL S.A.	81 264 434,16	0,57	
WORK SERVICE S.A.	27 729 359,06	0,19	
ZAKŁADY PRZEMYSŁU CUKIERNICZEGO OTMUCHÓW S.A.	196 416,89	0,00	
ZPUE S.A.	40 408 921,02	0,28	
ZUE S.A.	8 901 503,31	0,06	
Akcje spółek notowanych na rynku regulowanym w państwach innych niż Rzeczpospolita Polska oraz obligacje zamienne na akcje tych spółek, a także notowane na tych rynkach praw poboru i praw do akcji	1 058 764 448,10	7,42	
9.	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA		44 438 854,05	0,31
BANK OF AMERICA CORP		6 988 222,37	0,05
BARRICK GOLD CORP		18 134 787,96	0,13
BASF SE		37 115 921,50	0,26
BAYER AG		26 585 983,94	0,19
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		25 351 147,29	0,18
BNP PARIBAS PARIS		70 362 040,28	0,49
CATERPILLAR INC		16 457 497,62	0,12
CHEVRON CORP		67 552 711,79	0,47
CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED		3 885 653,00	0,03
DAIMLER AG		33 560 813,18	0,23
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		8 569 011,07	0,06
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		22 212 942,19	0,16
ERSTE GROUP BANK AG		166 781 667,77	1,17
FONDUL PROPRIETATEA SA/FUND		15 588 102,28	0,11
HALLIBURTON CO		37 428 848,82	0,26
INTESA SANPAOLO SPA		50 840 434,79	0,36
KBC GROEP N.V.		56 352 612,81	0,39
KOMERCNI BANKA AS		79 759 071,36	0,56
MONETA MONEY BANK A.S.		34 963 968,00	0,24
NEWMONT MINING CORP		26 776 767,08	0,19
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		3 516 217,44	0,02
SIEMENS AG-REG		33 911 502,45	0,24
THYSSENKRUPP AG		28 279 536,18	0,20
TOTAL SA		58 574 972,60	0,41
UNIPETROL AS		23 085 880,92	0,16
VALEO SA		28 569 413,73	0,20
ZALANDO SE		33 119 865,63	0,23
11. Certyfikaty inwestycyjne emitowane przez fundusze inwestycyjne zamknięte		4 158 123,20	0,03
11.	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
SKARBIEC-RYNKU NIERUCHOMOŚCI FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY - PLSKRNR00018		4 158 123,20	0,03
Obligacje i inne dłużne papiery wartościowe inne niż będące przedmiotem oferty publicznej, emitowane przez jednostki samorządu terytorialnego lub ich związki		37 070 400,00	0,26
17.	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
MIASTO STOŁECZNE WARSZAWA - PL0003200058 - 2025-10-12		37 070 400,00	0,26
19. Obligacje przychodowych, o których mowa w ustawie z dnia 29 czerwca 1995 r. o obligacjach		20 571 803,54	0,15
19.	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
MIEJSKIE WODOCIĄGI I KANALIZACJA W BYDGOSZCZY SP. Z O.O. - ONMWIKB290420 - 2029-04-20		20 571 803,54	0,15
Obligacje będące przedmiotem oferty publicznej na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej emitowane przez inne podmioty niż jednostki samorządu terytorialnego lub ich związki, które zostały zabezpieczone w wysokości odpowiadającej pełnej wartości nominalnej i ewentualnemu oprocentowaniu		48 890 223,25	0,34
21.	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
ORBIS S.A. - FLORBIS00055 - 2021-07-29		6 070 402,36	0,04
ORBIS S.A. - FLORBIS00048 - 2020-06-26		42 819 820,89	0,30
Obligacje i inne dłużne papiery wartościowe, dla których podmiotami zobowiązanymi do spełnienia świadczeń są spółki notowane na rynku regulowanym na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej, inne niż papiery wartościowe, o których mowa w pkt 21 i 22		368 954 492,19	2,59
25.	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
CYFROWY POLSAT S.A. - PLCFRPT00039 - 2021-07-21		83 224 800,00	0,58
AMREST HOLDINGS SE - PLAMRST00017 - 2018-06-30		20 327 612,09	0,14
PBG S.A. - PLPBG0000250 - 2018-12-31		322 664,78	0,00
PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA S.A. - PLPGER000051 - 2018-06-27		50 136 830,81	0,35
OT LOGISTICS S.A. - PLODRTS00074 - 2018-11-20		20 122 000,00	0,14
AMREST HOLDINGS SE - PLAMRST00025 - 2019-09-10		20 014 910,06	0,14
PBG S.A. - PLPBG0000284 - 2019-09-10		4 146 240,42	0,03
PBG S.A. - PLPBG0000268 - 2019-06-30		1 233 861,20	0,01
PBG S.A. - PLPBG0000243 - 2018-06-30		1 152 714,69	0,01
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S.A. - PLPKN0000083 - 2019-02-27		92 168 365,25	0,65
PBG S.A. - PLPBG0000276 - 2019-12-31		876 964,09	0,01
PLAZA CENTERS N.V. - NL0009524107 - 2018-05-16		3 720 277,77	0,03
ENEA S.A. - PLENEA000088 - 2020-02-10		70 716 360,53	0,50

	GETIN NOBLE BANK S.A. - PLNOBLE00033 - 2018-06-29	790 890,50	0,00
	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
29.	Listy zastawne	50 379 329,77	0,35
	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
	PKO BANK HIPOTECZNY S.A. - PLPKOHP00025 - 2021-04-28	50 379 329,77	0,35
36.	Środki pieniężne	13 056 009,36	0,09
	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
	Depozyt: P000048302 - DEUTSCHEBANK - 2017-12-31	1 468 728,23	0,01
	Depozyt: P000048306 - DEUTSCHEBANK - 2017-12-31	11 587 281,13	0,08
37.	Należności	3 728 793,22	0,03