

Roczna struktura aktywów

Data wyceny: 2019-12-31

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	1 108 081 937,72	9,18
	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
	Depozyt: P000162083 - ALIOR BANK - 2020-02-07	200 000 000,00	1,66
	Depozyt: P000165614 - MBANK - 2020-02-17	150 000 000,00	1,24
	Depozyt: P000165615 - MBANK - 2020-02-17	150 000 000,00	1,24
	Depozyt: P000167505 - SOCIETE GENERALE POLSKA - 2020-02-21	80 000 000,00	0,66
	Depozyt: P000167506 - SOCIETE GENERALE POLSKA - 2020-02-21	80 000 000,00	0,66
	Depozyt: P000170530 - PKO BP BANK 2020-02-17	50 000 000,00	0,42
	Depozyt: P000171347 - SANTANDER BANK -2020-02-20	100 000 000,00	0,83
	Depozyt: P000171573 - SOCIETE GENERALE POLSKA -2020-03-23	50 000 000,00	0,42
	Depozyt: P000172148 - DEUTSCHE BANK - 2020-01-20	100 000 000,00	0,83
	Depozyt: P000172149 - BNP PARIBAS - 2020-01-17	50 000 000,00	0,41
	Depozyt: P000172631 - DEUTSCHE BANK -2020-01-02	98 081 937,72	0,81
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	9 580 405 363,06	79,34
	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
	11 BIT STUDIOS S.A.	24 929 555,00	0,21
	AGORA S.A.	21 689 157,34	0,18
	ALIOR BANK S.A.	129 649 471,77	1,07
	AMREST HOLDINGS SE	154 370 018,78	1,28
	ASSECO BUSINESS SOLUTIONS S.A.	125 506 559,45	1,04
	ASSECO POLAND S.A.	208 877 077,60	1,73
	ASSECO SOUTH EASTERN EUROPE S.A.	51 835 489,30	0,43
	ASTARTA HOLDING N.V.	4 907 107,33	0,04
	ATAL S.A.	19 495 705,70	0,16
	ATM GRUPA S.A.	23 736 345,76	0,20
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE S.A.	84 667 472,05	0,70
	BANK MILLENNIUM S.A.	81 030 286,58	0,67
	BANK POLSKA KASA OPIEKI S.A.	376 364 048,46	3,12
	BENEFIT SYSTEMS S.A.	235 615 839,28	1,95
	BUDIMEX S.A.	123 707 542,45	1,02
	CAPITAL PARK S.A.	88 148 165,06	0,73
	CCC S.A.	138 561 749,47	1,15
	CD PROJEKT S.A.	481 036 290,12	3,98
	CELON PHARMA S.A.	56 750 518,45	0,47
	CEZ A.S.	34 708 894,35	0,29
	CIECH S.A.	44 488 584,62	0,37
	COMARCH S.A.	216 951 583,02	1,80
	COMP S.A.	57 888 130,50	0,48
	CYFROWY POLSAT S.A.	189 754 858,74	1,57
	DEVELIA S.A.	88 433 869,15	0,73
	DINO POLSKA S.A.	44 525 231,40	0,37
	ECHO INVESTMENT S.A.	58 562 031,73	0,49
	ELEMENTAL HOLDING S.A.	26 808 966,20	0,22
	ENEA S.A.	104 017 341,60	0,86
	ENERGA S.A.	50 028 754,89	0,41
	ENERGOINSTAL S.A.	4 492,76	0,00
	ERBUD S.A.	2 284 440,09	0,02
	EUROCASH S.A.	90 055 539,23	0,75
	FABRYKA FARB I LAKIERÓW ŚNIEŻKA S.A.	24 827 501,37	0,21
	FABRYKI MEBLI FORTE S.A.	15 774 831,27	0,13
	FAMUR S.A.	48 109 545,84	0,40
	FERRO S.A.	11 418 345,20	0,09
	GETBACK S.A.	0,00	0,00
	GETIN HOLDING S.A.	54 228,83	0,00
	GLOBE TRADE CENTRE S.A.	39 485 068,30	0,33
	GRUPA AZOTY S.A.	66 549 014,74	0,55
	GRUPA KĘTY S.A.	184 966 091,94	1,53
	GRUPA LOTOS S.A.	185 729 762,71	1,54
	INDUSTRIAL MILK COMPANY S.A.	5 409 499,09	0,05
	ING BANK ŚLĄSKI S.A.	268 960 120,21	2,23
	INTER CARS S.A.	94 724 880,21	0,78
	INTROL S.A.	2 544 507,50	0,02
	IZOSTAL S.A.	1 318 250,00	0,01
	JASTRZEBSKA SPÓŁKA WĘGLOWA S.A.	24 430 633,06	0,20
	KERNEL HOLDING S.A.	508 484,90	0,00
	KGHM POLSKA MIEDŹ S.A.	441 024 860,16	3,65
	KRUK S.A.	142 923 325,69	1,18
	LIVECHAT SOFTWARE S.A.	42 366 458,02	0,35
	LPP S.A.	124 008 943,52	1,03
	LUBELSKI WĘGIEL BOGDANKA S.A.	11 369 477,77	0,09
	MABION S.A.	7 247 480,12	0,06
	MANGATA HOLDING S.A.	133 152,00	0,00
	MBANK S.A.	158 738 285,40	1,32
	MENNICA POLSKA S.A.	119 130 902,00	0,99
	MLP GROUP S.A.	89 853 383,43	0,74
	MOL MAGYAR OLAJ- ES GAZIPARI RT.	67 113 526,05	0,56
	NEWAG S.A.	61 568 255,57	0,51
	OPONEO.PL S.A.	3 694 719,85	0,03
	ORANGE POLSKA S.A.	207 684 962,54	1,72
	OT LOGISTICS S.A.	10 212 164,12	0,08
	P.A.NOVA S.A.	18 001 873,93	0,15
	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA S.A.	235 815 731,22	1,95
	PKP CARGO S.A.	38 943 093,15	0,32

PLAY COMMUNICATIONS S.A.	89 585 379,47	0,74
POLSKI HOLDING NIERUCHOMOŚCI S.A.	15 827 927,54	0,13
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S.A.	824 514 903,99	6,83
POLSKIE GÓRNICZTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO S.A.	233 008 672,53	1,93
POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI S.A.	927 984 256,49	7,69
POWSZECHNY ZAKŁAD UBEZPIECZEŃ S.A.	557 694 829,19	4,62
PZ CORMAY S.A.	1 255 283,05	0,01
RADPOL S.A.	1 783 567,44	0,02
RAWPLUG S.A.	1 456 660,00	0,01
RONSON DEVELOPMENT S.E.	10 581 799,45	0,09
SANOK RUBBER COMPANY S.A.	17 856 801,57	0,15
SANTANDER BANK POLSKA S.A.	484 738 215,43	4,01
SECO/WARWICK S.A.	10 509 087,20	0,09
SKARBIEC HOLDING S.A.	9 506 038,61	0,08
SOHO DEVELOPMENT S.A.	155 667,86	0,00
SOLAR COMPANY S.A.	407 160,00	0,00
STELMET S.A.	1 819 125,00	0,02
SYNEKTIK S.A.	2 615 851,48	0,02
TAURON POLSKA ENERGIA S.A.	27 788 861,14	0,23
UNICREDIT S.P.A.	7 627 687,18	0,06
VOXEL S.A.	21 807 106,22	0,18
WARIMPEX FINANZ- UND BETEILIGUNGS AG	35 143 567,26	0,29
WAWEL S.A.	59 814 070,94	0,50
ZAKŁADY PRZEMYSŁU CUKIERNICZEGO OTMUCHÓW S.A.	80 832,14	0,00
ZPUE S.A.	36 679 336,09	0,30
ZUE S.A.	6 130 197,85	0,05
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	540 699 446,57	4,48
Emitent		
KOMERCNI BANKA AS	55 609 680,00	0,46
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	31 783 527,68	0,26
BASF SE	11 759 208,98	0,10
BAYER AG	3 761 044,60	0,03
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18 999 468,09	0,16
BNP PARIBAS PARIS	60 968 646,41	0,50
DAIMLER AG	19 983 515,88	0,17
ERSTE GROUP BANK AG	23 548 147,39	0,19
INTESA SANPAOLO SPA	64 233 169,92	0,53
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	53 083 267,13	0,44
KBC GROEP N.V.	54 259 251,90	0,45
SIEMENS AG-REG	16 873 710,06	0,14
THYSSENKRUPP AG	3 589 063,80	0,03
TOTAL SA	3 142 773,00	0,03
VALEO SA	1 471 354,34	0,01
ZALANDO SE	15 391 922,40	0,13
FONDUL PROPRIETATEA SA/FUND	15 831 117,68	0,13
BANK OF AMERICA CORP	802 529,96	0,01
BARRICK GOLD CORP	25 301 976,49	0,21
CATERPILLAR INC	2 804 221,68	0,02
CHEVRON CORP	1 372 982,48	0,01
CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED	606 796,51	0,01
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	644 241,83	0,01
HALLIBURTON CO	20 444 538,18	0,17
NEWMONT GOLDCORP CORPORATION	33 827 063,33	0,28
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	606 226,85	0,00
Obligacje i inne dłużne papiery wartościowe inne niż będące przedmiotem oferty publicznej, emitowane przez jednostki samorządu terytorialnego lub ich związki	37 668 900,00	0,31
Emitent		
MIASTO STOŁECZNE WARSZAWA - PL0003200058 - 2025-10-12	37 668 900,00	0,31
19. Obligacje przychodowych, o których mowa w ustawie z dnia 29 czerwca 1995 r. o obligacjach	16 690 717,92	0,14
Emitent		
MIEJSKIE WODOCIĄGI I KANALIZACJA W BYDGOSZCZY SP. Z O.O. - ONMWIKB290420 - 2029-04-20	16 690 717,92	0,14
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	48 865 135,50	0,40
Emitent		
ORBIS S.A. - PLORBIS00055 - 2021-07-29	6 136 768,88	0,05
ORBIS S.A. - PLORBIS00048 - 2020-06-26	42 728 366,62	0,35
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	502 122 694,72	4,16
Emitent		
OT LOGISTICS S.A. - PLODRTS00074 - 2021-04-30	16 000 104,90	0,13
ENEA S.A. - PLENEA000088 - 2020-02-10	151 625 386,50	1,26
ENEA S.A. - PLENEA000096 - 2024-06-26	160 865 536,00	1,33
BANK MILLENNIUM S.A. - PLBIG0000461 - 2029-01-30	101 014 438,00	0,84
PBG S.A. - PLPBG0000268 - 2020-01-31	221 156,82	0,00
PBG S.A. - PLPBG0000276 - 2020-01-31	167 387,76	0,00
PBG S.A. - PLPBG0000284 - 2020-06-30	843 079,14	0,01
SANTANDER BANK POLSKA S.A. - PLBZ00000275 - 2028-04-05	20 621 605,60	0,17
KGHM POLSKA MIEDZ S.A. - PLKGHM000041 - 2029-06-27	50 764 000,00	0,42
Emitent		
29. Listy zastawne	110 864 864,88	0,92
Emitent		
PKO BANK HIPOTECZNY S.A. - PLPKOHP00025 - 2021-04-28	50 413 135,20	0,42
PEKAO BANK HIPOTECZNY S.A. - PLBPHHP00218 - 2025-09-10	60 451 729,68	0,50
Obligacje inne niż wymienione w pkt 33, bankowe papiery wartościowe lub listy zastawne, emitowane przez Bank Gospodarstwa Krajowego	119 996 935,09	0,99
Emitent		
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO - PL0000500245 - 2023-02-19	119 996 935,09	0,99
36. Środki pieniężne	3 490 335,55	0,03
Emitent		
Depozyt: P000172627 DEUTSCHE BANK - 2020-01-02	3 182 114,26	0,03
Depozyt: P000172630 - DEUTSCHBANK - 2020-01-02	308 221,29	0,00
37. Należności	6 258 197,44	0,05

	Emitent	Wartość	Udział w aktywach
Odsetki od lokat terminowych		1 417 465,75	0,01
Należności od PTE		7 173,09	0,00
Należności z tytułu dywidend		4 833 558,60	0,04