

Kategoria lokaty	Wartość	Udział w wartości aktywów (%)
1. Obligacje, bony skarbowe i inne papiery emitowane przez Skarb Państwa i NBP, a także pożyczki i kredyty udzielane tym podmiotom;	2 051 937 227,51	63,37
Emitent - Nazwa papieru - Data wykupu	Wartość	Udział w aktywach
Skarb Państwa - DS1110 - 24/11/2010	117 558 365,84	3,63
Skarb Państwa - PS0206 - 12/02/2006	32 452 500,00	1,00
Skarb Państwa - PS0506 - 12/05/2006	53 516 500,00	1,65
Skarb Państwa - PS1106 - 12/11/2006	146 283 200,00	4,52
Skarb Państwa - DS0509 - 24/05/2009	289 642 176,00	8,95
Skarb Państwa - PS0507 - 12/05/2007	99 457 234,79	3,07
Skarb Państwa - WS0922 - 23/09/2022	21 668 800,00	0,67
Skarb Państwa - PS0608 - 24/06/2008	279 355 050,00	8,63
Skarb Państwa - DS1013 - 24/10/2013	87 456 372,08	2,70
Skarb Państwa - DZ1111 - 24/11/2011	84 952 281,96	2,62
Skarb Państwa - OK0406 - 12/04/2006	69 146 000,00	2,14
Skarb Państwa - OK0806 - 12/08/2006	97 470 000,00	3,01
Skarb Państwa - OK1206 - 12/12/2006	48 000 000,00	1,48
Skarb Państwa - DS1015 - 24/10/2015	73 155 469,58	2,26
Skarb Państwa - OK0407 - 12/04/2007	112 347 817,40	3,47
Skarb Państwa - PS0310 - 24/03/2010	176 347 504,66	5,45
Skarb Państwa - OK0807 - 12/08/2007	148 864 000,00	4,60
Skarb Państwa - SP0610 - 01/06/2010	20 600 000,00	0,63
Skarb Państwa - OK1207 - 12/12/2007	93 663 955,20	2,89
2. Obligacje i inne dłużne papiery wartościowe opiewające na świadczenia pieniężne gwarantowane lub poręczone przez Skarb Państwa albo NBP, a także depozyty, kredyty i pożyczki gwarantowane lub poręczone przez Skarb Państwa albo NBP;	0,00	0,00
3. Depozyty bankowe i bankowe papiery wartościowe w walucie polskiej;	129 052 711,18	3,99
Emitent - Nazwa papieru - Data zwrotu	Wartość	Udział w aktywach
BRE Bank SA - LO30122005N001 - 02/01/2006	2 834 772,74	0,09
Skarb Państwa - Bon Skarbowy - 02/01/2006	36 145 200,00	1,12
Skarb Państwa - Bon Skarbowy - 04/01/2006	90 072 738,44	2,78
4. Depozyty bankowe i bankowe papiery wartościowe, w walutach państw będących członkami OECD oraz innych państw, w których RP zawarła umowy o popieraniu i wzajemnej ochronie inwestycji, nabywane wyłącznie w celu rozliczenia bieżących zobowiązań funduszu;	0,00	0,00
5. Akcje spółek notowanych na regulowanym rynku giełdowym, a także notowane na regulowanym rynku giełdowym prawa poboru, prawa do akcji oraz obligacje zamienne na akcje tych spółek;	996 724 253,70	30,78
Emitent	Wartość	Udział w aktywach
Agora SA	13 920 998,79	0,43
Alchemia SA	7 070 035,50	0,22
Alma Market SA	2 111 626,84	0,06
Ambra SA	2 205 503,65	0,07
AmRest Holdings NV	2 506 822,28	0,08
Artman SA	249 757,44	0,01
Asseco Poland SA	6 851 330,90	0,21
Asseco Poland SA - prawa do akcji	798 838,04	0,02
ATM Grupa SA	910 616,00	0,03
ATM SA	2 631 555,00	0,08
Bank Polska Kasa Opieki SA	80 718 844,80	2,49
Bank Przemysłowo-Handlowy SA	48 449 869,78	1,50
Bank Zachodni WBK SA	22 933 215,00	0,71
Barlinek SA	1 083 750,00	0,03
Bioton SA	3 941 080,00	0,12
BorsodChem Rt	1 307 512,00	0,04
BRE Bank SA	13 291 690,10	0,41
Broker FM SA	1 969 041,57	0,06
Budimex SA	2 459 845,17	0,08
Cersanit Krasnystaw SA	15 766 643,20	0,49
Ciech SA	2 436 700,00	0,07
ComArch SA - obligacje	6 131 041,70	0,19
Comp SA	3 609 270,00	0,11
Computer Service Support SA	1 804 386,60	0,06
ComputerLand SA	12 437 291,20	0,38
Decora SA	2 376 017,60	0,07
Echo Investment SA	27 462 463,00	0,85
Eldorado SA	3 894 105,86	0,12
Elektrobudowa SA	8 909 984,70	0,28
EMAX SA	5 431 140,00	0,17
Eurocash SA	2 946 866,70	0,09
Fabryka Farb i Lakierów Śnieżka SA	1 037 489,67	0,03
Fabryka Śrub w Łąccu Śrubex SA	1 220 402,94	0,04
Fabryki Mebli Forte SA	4 587 734,06	0,14
Farmacol SA	8 220 635,80	0,25
Firma Chemiczna Dwory SA	3 305 225,00	0,10
Firma Oponiarska Dębica SA	4 839 000,00	0,15
Getin Holding SA	19 218 470,48	0,59
Globe Trade Centre SA	23 578 732,80	0,73
Grupa Kęty SA	13 032 244,40	0,40
Grupa Lotos SA	3 921 490,24	0,12
ING Bank Śląski SA	19 138 240,84	0,59

Instal Kraków SA	2 442 745,23	0,08
Inter Cars SA	1 543 802,72	0,05
Inter Groclin Auto SA	4 775 065,47	0,15
JC Auto SA	4 223 106,00	0,13
KGHM Polska Miedź SA	13 871 338,20	0,43
Koelner SA	10 397 265,96	0,32
Kredyt Bank SA	10 527 960,05	0,33
Krośnieńskie Huty Szkła Krosno SA	781 228,80	0,02
Lena Lighting SA	2 592 000,00	0,08
Lubelskie Zakłady Przemysłu Spirytusowego Polmos SA	3 627 360,00	0,11
LPP SA	28 119 589,16	0,87
Mondi Packaging Paper Świecie SA	9 674 705,04	0,30
Opoczno SA	2 287 040,28	0,07
Orbis SA	7 685 075,24	0,24
OTP Bank Ltd.	10 441 577,57	0,32
PBG SA	3 551 736,00	0,11
PEKAES SA	1 740 945,00	0,05
Pfleiderer Grajewo SA	15 670 673,10	0,48
Polimex-Mostostal Siedlce SA	2 768 369,08	0,09
Polska Grupa Farmaceutyczna SA	5 776 672,73	0,18
Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	142 818 720,88	4,41
Polskie Górnictwo Naftowe i Gazownictwo SA	23 724 204,00	0,73
Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski SA	82 465 143,61	2,55
Prokom Software SA	7 480 000,00	0,23
Provimi-Rolimpex SA	4 282 720,00	0,13
Przedsiębiorstwo Polmos Białystok SA	8 590 616,43	0,27
Softbank SA	1 577 903,45	0,05
Spin SA	2 533 088,90	0,08
Swissmed Centrum Zdrowia SA	627 897,60	0,02
Telekomunikacja Polska SA	107 381 375,67	3,32
Toora Poland SA	1 761 000,00	0,05
TVN SA	10 709 688,33	0,33
Vistula SA	13 838 242,08	0,43
Wilbo SA	1 053 791,30	0,03
Zakłady Azotowe Puławy SA	6 786 119,58	0,21
Zakłady Chemiczne i Tworzyw Sztucznych Boryszew SA	15 084 971,20	0,47
Zakłady Chemiczne Police SA	3 697 228,08	0,11
Zakłady Lentex SA	204 934,14	0,01
Zelmer SA	1 954 150,00	0,06
Zespół Elektrociepłowni Wrocławskich Kogeneracja SA	6 936 693,17	0,21
6. Akcje spółek notowanych na regulowanym rynku pozagiełdowym lub zdematerializowane zgodnie z przepisami ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi, akcje spółek niebędących przedmiotem obrotu na rynku regulowanym, a także notowane na regulowanym rynku pozagiełdowym lub zdematerializowane, lecz nienotowane na rynku regulowanym, prawa poboru, prawa do akcji oraz obligacje zamienne na akcje tych spółek;	5 060 641,30	0,16
Emitent	Wartość	Udział w aktywach
Sfinks Polska SA	5 060 641,30	0,16
7. Akcje NFI	909 376,44	0,03
Emitent	Wartość	Udział w aktywach
NFI Octava SA	909 376,44	0,03
8. Certyfikaty inwestycyjne emitowane przez fundusze inwestycyjne zamknięte;	29 150 894,29	0,90
Emitent - Nazwa papieru	Wartość	Udział w aktywach
BZ WBK AIB Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych SA - Arka BZ WBK Fundusz Rynku Nieruchomości FIZ	10 000 000,00	0,31
BPH Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych SA - BPH Fundusz Inwestycyjny Zamknięty Sektora Nieruchomości	19 150 894,29	0,59
9. Jednostki uczestnictwa zbywane przez fundusze inwestycyjne otwarte lub specjalistyczne fundusze inwestycyjne otwarte;	0,00	0,00
10. Obligacje i inne dłużne papiery wartościowe emitowane przez jednostki samorządu terytorialnego, ich związki lub miasto stołeczne Warszawa, zdematerializowane zgodnie z przepisami ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi;	0,00	0,00
11. Inne niż zdematerializowane obligacje i inne dłużne papiery wartościowe emitowane przez jednostki samorządu terytorialnego, ich związki lub miasto stołeczne Warszawa;	0,00	0,00
12. Obligacje przychodowe, o których mowa w ustawie z 29 czerwca 1995 r. o obligacjach;	0,00	0,00
13. Zdematerializowane zgodnie z przepisami ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi, obligacje emitowane przez inne podmioty niż jednostki samorządu terytorialnego, ich związki, miasto stołeczne Warszawa, które zostały zabezpieczone w wysokości odpowiadającej pełnej wartości nominalnej i ewentualnemu oprocentowaniu;	0,00	0,00
14. Inne niż zdematerializowane obligacje i inne dłużne papiery wartościowe emitowane przez inne podmioty niż jednostki samorządu terytorialnego, ich związki, miasto stołeczne Warszawa, które zostały zabezpieczone w wysokości odpowiadającej pełnej wartości nominalnej i ewentualnemu oprocentowaniu;	7 023 133,33	0,22
Emitent - Nazwa papieru - Data wykupu	Wartość	Udział w aktywach
Ekoenergiz SA - Ekoenergiz - 10/10/2007	7 023 133,33	0,22
15. Obligacje i inne dłużne papiery wartościowe emitowane przez spółki publiczne, które nie zostały dopuszczone do publicznego obrotu;	3 960 362,00	0,12
Emitent - Nazwa papieru - Data wykupu	Wartość	Udział w aktywach
ComputerLand SA - ComputerLand - 21/05/2006	3 960 362,00	0,12
16. Zdematerializowane zgodnie z przepisami ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi obligacje i inne dłużne papiery wartościowe, inne niż w pkt. 10 i 13;	0,00	0,00
17. Listy zastawne	0,00	0,00
18. Kwity depozytowe, w rozumieniu ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi, dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym na terytorium RP;	0,00	0,00
19. Należności ogółem	1 828 572,83	0,06
Rodzaj należności	Wartość	Udział w aktywach
Należności od Towarzystwa	0,00	0,00
Należności z tytułu dywidendy	23 994,60	0,00

Należności z tytułu wpłat na rachunek premiiowy	158 554,21	0,01
Należności z tytułu zbytych składników portfela inwestycyjnego	1 617 922,66	0,05
Pozostałe należności	28 101,36	0,00
20. Środki pieniężne na rachunkach bankowych;	12 136 617,40	0,37
Rodzaj rachunku bankowego	Wartość	Udział w aktywach
Środki pieniężne na rachunku przeliczeniowym	12 136 617,40	0,37