

Raport półroczny struktura aktywów na dzień 30.12.2011.

| L.p. | PORTFEL INWESTYCYJNY | Wyszczególnienie | Liczba papierów wartościowych | Wartość na dzień wyceny | Udział w aktywach |
|------|---|---|-------------------------------|--------------------------|-------------------|
| 1 | 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 | Suma | | 3 074 944 044,22 | 30,46% |
| | | Bank Polska Kasa Opieki S.A. | 1 428 045 | 201 825 599,85 | 2,00% |
| | | KGHM Polska Miedź S.A. | 1 440 023 | 158 546 532,30 | 1,57% |
| | | Lubelski Węgiel Bogdanka S.A. | 1 688 648 | 175 754 483,84 | 1,74% |
| | | PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. | 7 850 907 | 164 319 483,51 | 1,63% |
| | | Polski Koncern Naftowy Orlen S.A. | 5 225 361 | 175 990 158,48 | 1,74% |
| | | Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A. | 7 818 237 | 254 874 526,20 | 2,52% |
| | | Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A. | 894 526 | 277 705 596,70 | 2,75% |
| 9 | Obligacje, bony i inne papiery wartościowe emitowane przez Skarb Państwa lub Narodowy Bank Polski, a także w pożyczki i kredyty udzielane tym podmiotom | Suma | | 5 325 269 008,73 | 52,74% |
| 9,1 | skarbowe | Suma | | 5 275 798 084,49 | 52,25% |
| | | DS1019 | 462 032 | 461 209 583,04 | 4,57% |
| | | DS1015 | 355 000 | 372 693 200,00 | 3,69% |
| | | DS1020 | 330 000 | 320 057 100,00 | 3,17% |
| | | IZ0816 | 364 016 | 461 661 185,08 | 4,57% |
| | | IZ0823 | 250 000 | 272 410 493,75 | 2,70% |
| | | OK0113 | 262 100 | 249 912 350,00 | 2,48% |
| | | OK0114 | 234 000 | 212 355 000,00 | 2,10% |
| | | OK0712 | 172 500 | 168 360 000,00 | 1,67% |
| | | OK1012 | 241 827 | 233 290 506,90 | 2,31% |
| | | PS0414 | 569 115 | 601 964 317,80 | 5,96% |
| | | PS0415 | 585 482 | 615 294 743,44 | 6,09% |
| | | PS0416 | 490 200 | 503 347 164,00 | 4,99% |
| | | WS0429 | 114 392 | 115 629 721,44 | 1,15% |
| | | WZ0115 | 185 000 | 187 919 300,00 | 1,86% |
| | | WZ0118 | 251 562 | 252 437 435,76 | 2,50% |
| 14,3 | Obligacje i inne dłużne papiery wartościowe emitowane przez spółki publiczne, inne niż papiery wartościowe, o których mowa w pkt 11 i 12. | Suma | | 564 672 937,76 | 5,59% |
| | Deutsche Bank AG London | DEUT0518 | 300 | 132 823 422,98 | 1,32% |
| 16,3 | Obligacjach emitowanych przez Bank Gospodarstwa Krajowego na zasadach określonych w ustawie z dnia 27 października 1994 r. o autostradach płatnych oraz o Krajowym Funduszu Drogowym. | | | 833 039 534,70 | 8,25% |
| | Obligacje Banku Gospodarstwa Krajowego | IDS1018 | 561 599 | 579 536 727,06 | 5,74% |
| | Obligacje Banku Gospodarstwa Krajowego | IDS1022 | 150 000 | 150 955 500,00 | 1,50% |
| | AKTYWA | Suma: | | 10 097 275 557,71 | 100,00 % |

DYREKTOR
Działu Księgowości Funduszu
Główny Księgowy Funduszu

Beata Kryczka-Bryskiewicz

039