

Raport półroczny struktura aktywów na dzień 30.06.2011.

L.p.	PORTFEL INWESTYCYJNY	Wyszczególnienie	Liczba papierów wartościowych	Wartość na dzień wyceny w tys.	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		3,736,470,245.04	35.69%
		Bank Polska Kasa Opieki S.A.	1,428,045	233,228,309.40	2.23%
		KGHM Polska Miedź S.A.	1,640,023	323,215,732.84	3.09%
		Lubelski Węgiel Bogdanka S.A.	1,428,895	163,622,766.45	1.56%
		PGE Polska Grupa Energetyczna S.A.	7,966,899	190,488,555.09	1.82%
		Polski Koncern Naftowy Orlen S.A.	5,427,639	280,337,554.35	2.68%
		Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.	7,352,483	309,392,484.64	2.96%
		PZU S.A.	698,273	263,584,092.04	2.52%
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		5,408,883,041.51	51.67%
9.1	skarbowe	Suma		5,310,548,993.71	48.59%
		DS1015	365,000	395,419,100.00	3.78%
		DS1017	130,000	133,324,100.00	1.27%
		DS1019	462,032	473,522,735.84	4.52%
		DS1020	330,000	329,396,100.00	3.15%
		DZ1111	241,983	247,430,037.33	2.36%
		IZ0816	354,016	458,252,796.73	4.38%
		IZ0823	250,000	276,101,732.00	2.64%
		OK0113	262,100	243,700,580.00	2.33%
		OK0712	250,000	238,025,000.00	2.27%
		OK1012	146,827	138,120,158.90	1.32%
		PS0414	294,115	303,164,918.55	2.90%
		PS0415	485,482	496,657,795.64	4.74%
		PS0416	245,200	244,322,184.00	2.33%
		WS0429	114,392	112,032,093.04	1.07%
		WS0922	245,000	253,577,450.00	2.42%
		WZ0118	251,562	252,920,434.80	2.42%
		WZ0121	176,874	175,176,009.60	1.67%
		WZ0911	125,000	126,455,000.00	1.21%
		WZ0115	220,000	224,114,000.00	2.14%
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		432,012,668.87	4.13%
		Deutsche Bank AG London	300	119,905,377.11	1.15%
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.			490,009,909.21	4.68%
	Obligacje Banku Gospodarstwa Krajowego	IDS1018	360,519	386,166,321.66	3.69%
IV.	Depozyty bankowe i bankowe papiery wartościowe w walucie polskiej	Suma		184,190,066.94	1.76%
		Bank Polska Kasa Opieki S.A.	1	155,000,000.00	1.48%
	AKTYWA		RAZEM	10,468,944,985.15	100.00%

DYREKTOR
Działu Księgowości Funduszu
Główny Księgowy Funduszu