

# Generali Otwarty Fundusz Emerytalny

Roczny raport o strukturze aktywów na dzień 31 grudnia 2009 r.

Lp	składnik aktywów	Emitent	wartość na dzień wyceny (PLN)	udział w aktywach (%)
1.	Obligacje, bony i inne papiery wartościowe emitowane przez Skarb Państwa lub NBP, a także pożyczki i kredyty udzielone tym podmiotom	Skarb Państwa	4 626 322 331,68	59,69*
		DS1013 24/10/2013	258 264 530,48	3,33
		DS1015 24/10/2015	317 917 400,00	4,10
		DS1017 25/10/2017	378 070 300,00	4,88
		DS1019 24/10/2019	357 471 774,10	4,61
		DS1110 24/11/2010	278 939 002,54	3,60
		DZ1111 24/11/2011	92 139 307,62	1,19
		OK0112 25/01/2012	72 384 000,00	0,93
		OK0710 25/07/2010	76 307 400,00	0,98
		OK0711 25/07/2011	125 698 500,00	1,62
		OK0712 25/07/2012	88 000 000,00	1,14
		PS0310 24/03/2010	83 969 600,00	1,08
		PS0412 25/04/2012	231 387 738,05	2,99
		PS0413 25/04/2013	338 903 196,82	4,37
		PS0414 24/04/2014	382 000 932,18	4,93
		PS0415 25/04/2015	205 576 742,91	2,65
		PS0511 24/05/2011	235 135 900,00	3,03
		WS0429 25/04/2029	73 742 983,84	0,95
		WS0437 25/04/2037	25 708 563,14	0,33
		WS0922 23/09/2022	310 304 000,00	4,00
		WZ0118 25/01/2018	406 727 360,00	5,25
		WZ0911 24/09/2011	287 673 100,00	3,71
2.	Obligacje i inne dłużne papiery wartościowe, opiewające na świadczenia pieniężne, gwarantowane lub poręczane przez Skarb Państwa albo NBP, a także depozyty, kredyty i pożyczki gwarantowane lub poręczane przez te podmioty	-----	40 920 758,24	0,53
		PKP 04/09/2014	40 920 758,24	0,53
3.	Depozyty bankowe i bankowe papiery wartościowe w walucie polskiej	-----	443 253 849,20	5,72
		BS20100127 27/01/2010	69 794 410,00	0,90
		LO30122009N002	75 000 000,00	0,97
		LO31122009N001	153 219 142,09	1,98
		OK0711 25/07/2011	46 450 000,00	0,60
		CD BGŻ 15/06/2010	73 211 646,36	0,94
		CD LUKAS 04/08/2011	25 578 650,75	0,33
4.	Depozyty bankowe i bankowe papiery wartościowe w walutach państw będących członkami OECD oraz innych państw, z którymi Rzeczpospolita Polska zawarła umowy o popieraniu i wzajemnej ochronie inwestycji, z tym że waluty te mogą być 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	-----	2 200 707 517,68	28,4*
		ACTION S.A.	11 712 455,40	0,15
		AGORA S.A.	24 440 440,20	0,32
		ALMA MARKET S.A.	703 986,47	0,01
		ARCTIC PAPER S.A.	7 325 671,62	0,09
		ARTERIA S.A.	5 215 251,35	0,07
		ASBISC ENTERPRISES PLC	4 337 837,98	0,06
		ASSECO POLAND S.A.	58 099 270,45	0,75
		ASSECO SLOVAKIA A.S.	4 907 717,10	0,06
		ASTARTA HOLDING N.V.	17 647 450,76	0,23
		ATLANTA POLAND S.A.	4 449 308,29	0,06
		ATM GRUPA S.A.	12 121 248,93	0,16
		BANK BPH S.A.	38 113 992,84	0,49
		BANK HANDLOWY W WARSZAWIE S.A.	20 395 896,95	0,26
		BANK POLSKA KASA OPIEKI S.A.	242 960 537,16	3,13
		BANK ZACHODNI WBK S.A.	89 627 017,35	1,16
		BARLINEK S.A.	6 510 906,06	0,08
		BOMI S.A.	23 594 427,12	0,30
		BRE BANK S.A.	24 854 967,55	0,32
		BUDIMEX S.A.	13 583 639,58	0,18
		CENTRAL EUROPEAN DISTRIBUTION CORPORATION	21 270 166,80	0,27
		CEZ AS	40 374 818,07	0,52
		CIECH S.A.	4 335 751,00	0,06
		CP ENERGIA S.A.	7 969 478,44	0,10
		CYFROWY POLSAT S.A.	13 703 912,56	0,18
		DOM DEVELOPMENT S.A.	17 175 768,74	0,22
		EFH ŻURAWIE WIEŻOWE S.A.	1 630 107,05	0,02
		ELEKTROBUDOWA S.A.	11 944 926,80	0,15
		ELSTAR OILS S.A.	26 655 143,28	0,34
		ENERGOINSTAL S.A.	2 183 789,24	0,03
		ERSTE BANK	19 806 043,02	0,26
		EUROMARK POLSKA S.A.	585 156,71	0,01
		FABRYKA FARB I LAKIERÓW ŚNIEŻKA S.A.	12 995 691,65	0,17
		FAM GRUPA KAPITAŁOWA S.A.	2 907 849,91	0,04
		FARMACOL S.A.	7 522 093,00	0,10
		FIRMA OPONIARSKA DĘBICA S.A.	2 784 359,04	0,04
		GETIN HOLDING S.A.	57 501 369,30	0,74
		GLOBE TRADE CENTRE S.A.	40 559 932,25	0,52
		GRAAL S.A.	2 827 590,74	0,04
		GRUPA KĘTY S.A.	13 856 741,59	0,18
		GRUPA LOTOS S.A.	44 101 955,56	0,57
		HYDROBUDOWA POLSKA S.A.	8 029 859,20	0,10
		IMMOEAST AG	19 530 946,80	0,25
		ING BANK ŚLĄSKI S.A.	21 855 340,62	0,28
		INTEGER.PL S.A.	17 488 895,52	0,23
		INTER CARS S.A.	15 471 148,23	0,20
		J.W. CONSTRUCTION HOLDING_S.A.	1 846 604,52	0,02
		KERNEL HOLDING S.A.	37 915 945,60	0,49
		KGHM POLSKA MIEDŹ S.A.	83 588 606,15	1,08

	KOPEX S.A.	14 388 375,49	0,19
	LPP S.A.	4 761 840,00	0,06
	LUBELSKI WĘGIEL BOGDANKA_S.A.	10 635 000,00	0,14
	MOL MAGYAR OLAJ - ES GAZIPARI NYILVANOSAN MUKODO RESZVENYTARSASAG	19 978 181,35	0,26
	MONDI ŚWIECIE S.A.	16 025 314,52	0,21
	MOSTOSTAL WARSZAWA S.A	17 491 270,16	0,23
	MOSTOSTAL ZABRZE HOLDING_S.A.	3 543 035,45	0,05
	NETIA S.A.	42 087 810,69	0,54
	NEW WORLD RESOURCES N.V.	20 697 982,81	0,27
	NG2 S.A.	38 859 307,94	0,50
	NOBLE BANK S.A.	4 310 620,16	0,06
	NORTH COAST S.A.	615 016,55	0,01
	OPTOPOL TECHNOLOGY S.A.	39 466 881,60	0,51
	ORZEŁ BIAŁY S.A.	6 376 220,64	0,08
	P.A. NOVA S.A.	2 644 161,30	0,03
	PBG S.A.	38 463 413,80	0,50
	PFLEIDERER GRAJEWÓ S.A.	16 001 227,08	0,21
	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA S.A.	85 470 000,00	1,10
	PLAZA CENTERS N.V.	24 311 863,08	0,31
	POLIMEX - MOSTOSTAL S.A.	42 487 002,36	0,55
	POLISH ENERGY PARTNERS S.A.	75 964 713,00	0,98
	POLNORD S.A.	23 741 656,18	0,31
	POLSKA GRUPA FARMACEUTYCZNA S.A.	4 275 294,66	0,06
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S.A.	110 352 496,16	1,42
	POLSKIE GÓRNICZTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO S.A.	41 196 070,77	0,53
	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI_S.A.	175 803 446,56	2,27
	PRZEDSIĘBIORSTWO ROBÓT INŻYNIERYJNYCH POL-AQUA S.A.	1 272 443,48	0,02
	STALPRODUKT S.A.	58 734 064,70	0,76
	SYNTHOS S.A.	6 857 918,84	0,09
	TELEKOMUNIKACJA POLSKA S.A.	51 565 169,55	0,67
	TUP S.A.	4 082 413,36	0,05
	ULMA CONSTRUCCION POLSKA_S.A.	15 944 285,25	0,21
	UNIBEP S.A.	1 095 377,34	0,01
	WARIMPEX FINANZ - UND BETEILIGUNGS AG	1 765 274,70	0,02
	ZAKŁADY AZOTOWE PUŁAWY_S.A.	7 367 385,36	0,10
	ZETKAMA S.A.	3 052 968,24	0,04

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	-----	0,00	0,00
		DUDA JPP	0,00	0,00
7.	Akcje Narodowych Funduszy Inwestycyjnych	-----	15 332 935,00	0,20
		NARODOWY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OCTAVA S.A.	15 332 935,00	0,20
8.	Certyfikaty inwestycyjne emitowane przez fundusze inwestycyjne zamknięte	-----	7 466 524,00	0,10
		SKARBIEC RYNKU NIERUCHOMOŚCI	7 466 524,00	0,10
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 dnia 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 wartości nominalnej wraz z ewentualnym oprocentowaniem	-----	0,00	0,00
15.	Obligacje i inne dłużne papiery wartościowe emitowane przez spółki publiczne, inne niż papiery wartościowe wymienione w pkt. 13 i 14	-----	193 898 891,28	2,50*
		EFG EUROBANK 08/01/2010	15 280 665,78	0,20
		MS FLOAT 16/10/2012	46 811 965,13	0,60
		GTC 15/05/2013	15 119 284,50	0,20
		GTC 28/04/2014	5 285 914,14	0,07
		NFI EMPIK 20/03/2012	15 263 568,00	0,20
		PKN ORLEN 27/02/2012	36 428 302,93	0,47
		PKO BP 30/01/2017	59 709 190,80	0,77
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	-----	38 855 650,00	0,50
		LZ BRE BANK HPA3	5 046 300,00	0,07
		LZ BRE BANK HPA4	15 034 950,00	0,19
		LZ BRE BANK PUA1	18 774 400,00	0,24
18.	Kwity depozytowe, w rozumieniu ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi, dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej	-----	0,00	0,00
19.	Obligacje emitowane przez Bank Gospodarstwa Krajowego na zasadach określonych w ustawie z dnia 27 października 1994 r. o autostradach płatnych oraz o Krajowym Funduszu Drogowym	-----	138 147 501,52	1,78*
		BGK 10/08/2012	12 245 411,52	0,16
		IPS1014 24/10/2014	85 060 350,00	1,10
		IDS1018 24/10/2018	40 841 740,00	0,53
20.	Środki pieniężne	-----	20 285 411,39	0,26
21.	Należności	-----	24 992 801,11	0,32
<b>AKTYWA RAZEM</b>			<b>7 750 184 171,10</b>	<b>100,00</b>

\* Suma poszczególnych pozycji nie jest równa udziałowi w aktywach funduszu danej kategorii lokat.  
Powstała różnica wynika z zaokrągleń.