

Generali Otwarty Fundusz Emerytalny

Roczny raport o strukturze aktywów na dzień 30 grudnia 2011 r.

<i>Lp</i>	<i>składnik aktywów</i>	<i>Emitent</i>	<i>wartość na dzień wyceny (PLN)</i>	<i>udział w aktywach (%)</i>
1.	Obligacje, bony i inne papiery wartościowe emitowane przez Skarb Państwa lub NBP, a także pożyczki i kredyty udzielone tym podmiotom	Skarb Państwa	6 230 698 970,23	55,13
		DS1013 - 24/10/2013	425 471 329,35	3,76
		DS1015 - 24/10/2015	419 936 000,00	3,72
		DS1017 - 25/10/2017	244 845 650,00	2,17
		DS1019 - 25/10/2019	566 516 801,94	5,01
		DS1020 - 25/10/2020	292 186 915,68	2,59
		DS1021 - 25/10/2021	146 536 198,34	1,30
		OK0113 - 25/01/2013	281 282 500,00	2,49
		OK0114 - 25/01/2014	170 058 240,00	1,50
		OK0712 - 25/07/2012	151 280 000,00	1,34
		OK0713 - 25/07/2013	55 800 000,00	0,49
		OK1012 - 25/10/2012	277 833 600,00	2,46
		PS0412 - 25/04/2012	285 260 089,70	2,52
		PS0413 - 25/04/2013	299 375 440,00	2,65
		PS0414 - 25/04/2014	420 825 536,92	3,72
		PS0415 - 25/04/2015	512 851 061,84	4,54
		PS0416 - 25/04/2016	323 448 300,00	2,86
		PS1016 - 25/10/2016	182 237 950,00	1,61
		WS0429 - 25/04/2029	5 118 792,48	0,05
		WS0922 - 23/09/2022	216 139 500,00	1,91
		WZ0115 - 25/01/2015	82 273 101,10	0,73
		WZ0118 - 25/01/2018	427 482 480,00	3,78
		WZ0121 - 25/01/2021	443 939 482,88	3,93
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	-----	0,00	0,00
3.	Depozyty bankowe i bankowe papiery wartościowe w walucie polskiej	-----	445 761 427,23	3,94*
		LO30122011N001	47 160 000,00	0,42

		LO30122011N002	188 000,00	0,00
		LO30122011N005	822,23	0,00
		OK1012 - 25/10/2012	200 008 365,00	1,77
		PS1016 - 25/10/2016	114 914 240,00	1,02
		OK0114 - 25/01/2014	83 490 000,00	0,74
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	-----	3 426 609 865,60	30,32*
		WARIMPEX FINANZ- UND BETEILIGUNGS AG	1 367 566,70	0,01
		KULCZYK OIL VENTURES S.A.	22 312 468,62	0,20
		AGROTON PUBLIC LIMITED	24 378 870,17	0,22
		ASBISC ENTERPRISES PLC	413 029,50	0,00
		CEZ A.S.	19 601 886,36	0,17
		NEW WORLD RESOURCES N.V.	4 396 083,04	0,04
		MOL HUNGARIAN OIL AND GAS COMPANY PLC.	26 575 789,63	0,24
		KERNEL HOLDING S.A.	42 768 066,20	0,38
		KSG AGRO S.A.	25 839 474,60	0,23
		COAL ENERGY S.A.	56 364 899,76	0,50
		ASTARTA HOLDING N.V.	17 802 893,70	0,16
		PLAZA CENTERS NV	6 894 443,40	0,06
		OVOSTAR UNION N.V.	47 364 701,28	0,42
		ACTION S.A.	29 689 358,16	0,26
		AGORA S.A.	5 927 611,20	0,05
		APATOR S.A.	33 908 815,36	0,30
		ARTERIA S.A.	7 908 414,99	0,07
		ARCTIC PAPER S.A.	13 957 128,64	0,12
		ATLANTA POLAND S.A.	5 920 718,52	0,05
		ATM GRUPA S.A.	4 419 484,20	0,04

	ULMA CONSTRUCCION POLSKA S.A.	16 170 194,59	0,14
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE S.A.	45 166 680,60	0,40
	BANK MILLENNIUM S.A.	20 781 505,64	0,18
	PPH BOMI S.A.	9 129 040,12	0,08
	BANK BPH S.A.	31 794 132,70	0,28
	BRE BANK S.A.	54 258 998,26	0,48
	BARLINEK S.A.	1 949 593,34	0,02
	ING BANK ŚLĄSKI S.A.	23 295 346,00	0,21
	BUDIMEX S.A.	18 275 748,15	0,16
	NG2 SA	45 473 629,74	0,40
	MONDI ŚWIECIE S.A.	1 178 616,60	0,01
	CYFROWY POLSAT S.A.	33 539 768,77	0,30
	COMP S.A.	21 796 033,50	0,19
	CP ENERGIA S.A	1 983 364,94	0,02
	CERSANT S.A	13 151 056,14	0,12
	FIRMA OPONIARSKA DĘBICA S.A.	1 855 435,12	0,02
	DOM DEVELOPMENT S.A.	4 033 292,04	0,04
	SYNTHOS S.A.	86 231 851,20	0,76
	ECHO INVESTMENT S.A.	27 102 411,84	0,24
	GRUPA EKO HOLDING S.A	393 598,94	0,00
	ELEKTROBUDOWA S.A.	43 900 673,96	0,39
	ENEA S.A.	74 981 617,44	0,66
	ENEL-MED S.A	9 035 875,60	0,08
	ENERGOINSTAL S.A.	2 116 801,84	0,02
	FAM GRUPA KAPITAŁOWA S.A	1 384 142,55	0,01
	FARMACOL S.A.	3 819 101,70	0,03
	GIEŁDA PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH W WARSZAWIE S.A	17 381 809,62	0,15
	GETIN HOLDING S.A	71 873 019,05	0,64
	GLOBE TRADE CENTRE S.A.	28 614 109,80	0,25
	HYDROBUDOWA POLSKA S.A.	2 134 460,87	0,02
	INSTAL KRAKÓW S.A	2 737 751,70	0,02
	INTER CARS S.A	2 380 402,35	0,02
	INTEGER.PL S.A	64 669 401,14	0,57
	JASTRZĘBSKA SPÓŁKA WĘGLOWA S.A	33 209 406,20	0,29
	J.W. CONSTRUCTION HOLDING S.A.	323 302,98	0,00
	ZAKŁADY METALI LEKKICH KĘTY S.A.	30 635 723,03	0,27
	KGHM POLSKA MIEDŹ S.A.	151 499 361,60	1,34

	PRZEDSIĘBIORSTWO EKSPORTU I IMPORTU KOPEX S.A.	13 530 227,30	0,12
	KREDYT BANK S.A	20 010 982,39	0,18
	KREDYT INKASO S.A	19 877 464,33	0,18
	KRUK S.A	47 744 634,96	0,42
	GRUPA LOTOS S.A.	20 876 503,88	0,18
	LUBELSKI WĘGIEL "BOGDANKA" S.A.	120 531 509,28	1,07
	PELION S.A.	3 364 015,20	0,03
	MENNICA PAŃSTWOWA S.A	8 817 472,50	0,08
	POLIMEX - MOSTOSTAL S.A.	33 277 824,12	0,29
	MOSTOSTAL WARSZAWA S.A.	4 707 217,84	0,04
	MOSTOSTAL ZABRZE HOLDING S.A.	786 278,40	0,01
	NETIA S.A.	1 879 320,11	0,02
	NOBLE BANK S.A.	3 030 904,80	0,03
	ORBIS S.A.	52 272 948,34	0,46
	ORZEŁ BIAŁY S.A.	8 548 307,10	0,08
	P.A. NOVA S.A.	2 282 389,34	0,02
	PBG S.A.	21 284 457,70	0,19
	PCC INTERMODAL S.A.	14 896 020,37	0,13
	BANK PEKAO S.A.	245 354 533,20	2,17
	PGE S.A.	157 868 836,58	1,40
	POLSKIE GÓRNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO S.A.	50 391 255,84	0,45
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S.A.	170 401 231,92	1,51
	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI S.A.	289 137 484,80	2,56
	POLISH ENERGY PARTNERS S.A	81 147 682,00	0,72
	POWSZECHNY ZAKŁAD UBEZPIECZEŃ S.A.	226 552 750,20	2,00
	FFIL ŚNIEŻKA S.A.	5 402 676,24	0,05
	ASSECO POLAND S.A.	64 422 589,06	0,57
	STALPRODUKT S.A.	33 556 980,00	0,30
	TAURON POLSKA ENERGIA S.A.	35 819 240,82	0,32
	TELEKOMUNIKACJA POLSKA S.A.	66 281 536,44	0,59
	TRANS UNIVERSAL POLAND S.A.	1 804 403,79	0,02
	TVN S.A.	31 211 791,30	0,28
	UNIBEP SA	1 136 307,81	0,01

		ZAKŁADY AZOTOWE PUŁAWY S.A.	16 795 980,82	0,15
		ZAKŁADY AZOTOWE W TARNOWIE-MOŚCICACH S.A.	88 214 157,72	0,78
		ZAKŁADY PŁYT WIÓROWYCH S.A. W GRAJEWIE	1 012 799,70	0,01
		ZETKAMA S.A.	6 273 892,08	0,06
		ASSECO SLOVAKIA A.S.	3 493 222,20	0,03
		CENTRAL EUROPEAN DISTRIBUTION CORPORATION	2 743 266,96	0,02
		BENEFIT SYSTEMS S.A.	19 573 248,60	0,17
		INPRO S.A	3 120 000,00	0,03
		MIRBUD S.A	5 231 931,91	0,05
		TOYA S.A	14 081 176,56	0,12
		HALLIBURTON COMPANY	11 793 447,40	0,10
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		1 301 973,48	0,01
		PHOTON ENERGY A.S.	1 301 973,48	0,01
7.	Akcje Narodowych Funduszy Inwestycyjnych		16 002 594,30	0,14
		NARODOWY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OCTAVA S.A.	16 002 594,30	0,14
8.	Certyfikaty inwestycyjne emitowane przez fundusze inwestycyjne zamknięte		6 360 290,00	0,06
		SKARBIEC RYNKU NIERUCHOMOŚCI FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY	6 360 290,00	0,06
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	-----	48 482 500,00	0,43
		WARSZAWA 25/10/2017	48 482 500,00	0,43
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	-----	101 089 880,00	0,89*
		SANTANDER 15/11/2012	50 359 385,00	0,45
		SANTANDER 30/09/2013	50 730 495,00	0,45
15.	Obligacje i inne dłużne papiery wartościowe emitowane przez spółki publiczne, inne niż papiery wartościowe wymienione w pkt. 13 i 14	-----	258 798 989,91	2,29

		ARCTIC 25/02/2013	22 367 457,28	0,20
		ARCTIC 25/02/2013N	7 524 536,32	0,07
		GTC 15/05/2013	15 128 343,00	0,13
		GTC 28/04/2014	5 461 982,33	0,05
		IDM 25/05/2012	5 051 550,00	0,04
		IDM 13/04/2012	5 112 200,00	0,05
		NFI EMPIK 24/11/2014	25 209 075,00	0,22
		PKN 27/02/2012	38 048 052,52	0,34
		PKO BP 10/02/2012	49 696 664,00	0,44
		PKO BP 30/10/2017	59 974 454,46	0,53
		BOŚ 18/05/2021	25 224 675,00	0,22
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	-----	142 186 545,18	1,26
		MMP 29/04/2016	20 365 523,16	0,18
		MMP 30/11/2015	30 636 723,20	0,27
		BGK 16/02/2013	40 737 158,32	0,36
		BGK 11/05/2014	50 447 140,50	0,45
17.	Listy zastawne	-----	20 277 800,00	0,18
		LZ BRE PUA1 27/07/2012	20 277 800,00	0,18
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	-----	580 657 499,87	5,14
		IDS1018 24/10/2018	268 304 400,00	2,37
		IDS1022 25/10/2022	150 964 178,87	1,34
		IPS1014 24/10/2014	149 122 350,00	1,32
		BGK 10/08/2012	12 266 571,00	0,11
20.	Środki pieniężne	-----	3 967 215,32	0,04
21.	Należności	-----	19 457 702,23	0,17
AKTYWA RAZEM			11 301 653 253,35	100,00

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