

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta             | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                 | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryglyka | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|----------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|---------------|--------------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ISHARES JPM EM LCL GOV BND | IE00B5M4WH52              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO           | USD                | 237 000.0                     | 40 960 296.4              | 1.2                                  | 1.3              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | OBLIGACJI DŁUGOTERMINOWYCH | AI0992351913              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |              | PLN                | 383 840.5                     | 111 728 282.8             | 3.4                                  | 3.5              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500294              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 105 000.0                     | 82 485 967.9              | 2.5                                  | 2.6              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | XS2530208490              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | EUR                | 5 000.0                       | 22 017 460.1              | 0.7                                  | 0.7              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | XS2778272471              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | EUR                | 9 500.0                       | 42 023 043.4              | 1.3                                  | 1.3              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500450              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 58 000.0                      | 59 744 567.8              | 1.8                                  | 1.9              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500468              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 115 000.0                     | 115 635 350.1             | 3.5                                  | 3.7              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500476              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 20 000.0                      | 19 105 772.4              | 0.6                                  | 0.6              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500328              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 40 275.0                      | 40 101 757.5              | 1.2                                  | 1.3              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA      | PLB200000366              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 57.0                          | 29 106 429.2              | 0.9                                  | 0.9              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000113783              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 103 422.0                     | 84 275 485.1              | 2.5                                  | 2.7              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000119087              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 128 000.0                     | 121 473 280.0             | 3.6                                  | 3.8              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000109427              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1.0                           | 992.8                     | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000112736              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 10 777.0                      | 9 218 753.6               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000115291              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 282 600.0                     | 297 837 792.0             | 8.9                                  | 9.4              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000116851              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 81 000.0                      | 78 914 250.0              | 2.4                                  | 2.5              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL0000118188              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 185 000.0                     | 177 886 750.0             | 5.3                                  | 5.6              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA         | PL0017000079              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 707.0                         | 7 276 218.8               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA         | PL0017000137              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | EUR                | 6 551.0                       | 29 343 400.9              | 0.9                                  | 0.9              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500443              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 95 000.0                      | 99 406 544.2              | 3.0                                  | 3.1              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500278              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1 317.0                       | 1 170 897.2               | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GHEIAMCO INVEST SP ZOO     | PLGHLMC00560              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 25 832.0                      | 18 378 434.7              | 0.6                                  | 0.6              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GMINA MIASTO GRUOZIADZ     | PL0326300079              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 774.0                         | 790 741.0                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj rynek | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfolio | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------|-----------------------|---------------|------------|--------------------|--------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GINA MIASTO GRUDZIADZ          | PL0326300095              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 3 297.0                        | 3 372 237.5               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | STATE OF ISRAEL                | IL0012035791              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | IL            | IL         | ILS                | 43 000 000.0                   | 54 331 914.5              | 1.6                                  | 1.7              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117743              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 133 000.0                      | 137 533 970.0             | 4.1                                  | 4.3              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117024              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 62 000.0                       | 60 433 260.0              | 1.8                                  | 1.9              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KEMBERTON SP ZOO               | PL0453600010              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 1 185.0                        | 1 085 501.5               | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MBANK                          | XS3244863729              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | EUR                | 20.0                           | 8 711 321.9               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MOL GROUP                      | PL0048000015              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | HU            | HU         | PLN                | 3 180.0                        | 3 218 353.1               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PL0198500038              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 5 702.0                        | 5 788 513.0               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | Orlen SA                       | PL0037100016              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 295.0                          | 25 541 361.5              | 0.8                                  | 0.8              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | PL0046700012              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 24.0                           | 12 242 862.1              | 0.4                                  | 0.4              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | PL0046700038              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 4.0                            | 2 037 765.1               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | XS2965663656              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | EUR                | 3 000.0                        | 13 210 818.9              | 0.4                                  | 0.4              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | XS3105979457              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | EUR                | 3 000.0                        | 12 853 398.3              | 0.4                                  | 0.4              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | JP561600AS27              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | JPY                | 20.0                           | 48 505 992.6              | 1.5                                  | 1.5              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117370              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 51 000.0                       | 52 109 250.0              | 1.6                                  | 1.6              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118519              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 188 000.0                      | 185 183 760.0             | 5.6                                  | 5.9              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000114393              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 1 716.0                        | 1 736 866.6               | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000115192              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 4 000.0                        | 4 235 520.0               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000116760              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 800.0                          | 796 304.0                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117990              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 288 000.0                      | 279 910 080.0             | 8.4                                  | 8.8              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118998              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 646 000.0                      | 602 433 760.0             | 18.1                                 | 19.0             |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000113460              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 2 682.0                        | 2 683 180.1               | 0.1                                  | 0.1              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta         | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu             | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryglyka | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfolio | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------|---------------|--------------|--------------------|--------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000119426              | N/D                        | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 50 000.0                       | 49 720 500.0              | 1.5                                  | 1.6              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | WĘGRY                  | XS3435288413              | N/D                        | Obligacje                   | N/D                   | HU            | HU           | EUR                | 8 000.0                        | 33 536 851.0              | 1.0                                  | 1.1              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RUMUNIA                | XS2571192284              | N/D                        | Obligacje                   | N/D                   | RO            | RO           | USD                | 9 750.0                        | 76 187 252.4              | 2.3                                  | 2.4              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RUMUNIA                | XS2538441598              | N/D                        | Obligacje                   | N/D                   | RO            | RO           | EUR                | 17 300.0                       | 79 218 183.6              | 2.4                                  | 2.5              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA  | XS3200021684              | N/D                        | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL           | EUR                | 70.0                           | 30 536 483.6              | 0.9                                  | 1.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SOBIESKI TOWERS SP ZOO | PL0460200010              | N/D                        | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 5 836.0                        | 6 274 525.2               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000105391              | N/D                        | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 2 500.0                        | 2 594 525.0               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE          | PL0336300010              | N/D                        | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 282.0                          | 2 899 839.8               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE          | PL0336300028              | N/D                        | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 282.0                          | 2 909 572.9               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE          | PL0336300036              | N/D                        | Obligacje                   | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 282.0                          | 2 919 400.3               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000115291              | N/D                        | Zobowiązania Repo           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 0.0                            | -138 280 963.8            | 0.0                                  | -4.4             |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000117990              | N/D                        | Zobowiązania Repo           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 0.0                            | -871 441.6                | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CBOT (T NOTE 10Y)      |                           | N/D                        | Kontrakt terminowy          | N/D                   |               |              | USD                | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.8              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | FX Swap                     | N/D                   |               |              |                    | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | FX Swap                     | N/D                   |               |              |                    | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | Swap walutowy               | N/D                   |               |              | PLN                | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | Swap walutowy               | N/D                   |               |              | ILS                | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | Spot-Forward                | N/D                   |               |              |                    | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | Spot-Forward                | N/D                   |               |              |                    | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | Spot-Forward                | N/D                   |               |              |                    | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | IRS                         | N/D                   |               |              | PLN                | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO034                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2020 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | Gotówka/Depozyty/Należności | N/D                   |               |              | PLN                | 0.0                            | 33 524 823.0              | 1.0                                  | 1.1              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                 | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryngła | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ALIOR BANK SA                  | PLAIOR00045               | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 25 190.0                      | 3 468 663.0               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ALLEGRO.EU SA                  | LU2237380790              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 288 467.0                     | 14 605 084.2              | 0.7                                  | 0.8              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BANK PEKAO                     | PLPEKA000016              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 49 981.0                      | 14 039 662.9              | 0.7                                  | 0.7              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BUDIMEX SA                     | PLBUDMX00013              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 606.0                       | 2 413 856.4               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CCC SA                         | PLCCC0000016              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 13 181.0                      | 1 132 247.9               | 0.0                                  | 0.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CD PROJEKT SA                  | PLOPTIC00011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 19 953.0                      | 5 068 062.0               | 0.2                                  | 0.3              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | DINO POLSKA SA                 | PLDINPL00011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 135 681.0                     | 4 758 332.7               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA          | PLBZ00000044              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11 959.0                      | 9 543 282.0               | 0.4                                  | 0.5              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GRUPA KETY SA                  | PLKETY000011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 789.0                       | 3 525 296.0               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA           | PLKGHM000017              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 38 655.0                      | 12 738 755.2              | 0.6                                  | 0.7              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KRUK SA                        | PLKRK0000010              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 5 056.0                       | 1 898 528.0               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | LPP SA                         | PLLPP0000011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 362.0                         | 8 992 080.0               | 0.4                                  | 0.5              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | Orlen SA                       | PLPKN0000018              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 142 108.0                     | 20 756 294.5              | 1.0                                  | 1.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA  | PLPGER000010              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 243 538.0                     | 3 687 165.3               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PEPCO GROUP NV.                | NL0015000AU7              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 50 887.0                      | 2 284 826.3               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B | PLPKO0000016              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 200 017.0                     | 24 802 108.0              | 1.2                                  | 1.3              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PZU                            | PLPZU0000011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 161 045.0                     | 11 482 508.5              | 0.5                                  | 0.6              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLTAURN000011             | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 295 730.0                     | 2 726 630.6               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ZABKA GROUP SA                 | LU2910446546              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | LU            | PL          | PLN                | 148 825.0                     | 4 710 311.2               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MBANK                          | PLBRE0000012              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 732.0                       | 5 484 174.0               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ISHARES CORE MSCI WORLD        | IE00B4LSY983              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO          | USD                | 280 000.0                     | 157 911 581.0             | 7.5                                  | 8.3              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ISHARES JPM EM LCL GOV BND     | IE00B5M4WH52              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO          | USD                | 137 000.0                     | 23 677 470.9              | 1.1                                  | 1.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH      | AI0992351941              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 2 701.8                       | 487 408.2                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta             | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                 | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryglyka | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfolio | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|----------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|---------------|--------------|--------------------|--------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | OBLIGACJE DŁUGOTERMINOWYCH | AI0992351913              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |              | PLN                | 24.8                           | 7 231.3                   | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | STABILNEGO WZROSTU         | AI0992351902              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |              | PLN                | 664.3                          | 147 283.0                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500294              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 35 000.0                       | 27 495 322.6              | 1.3                                  | 1.4              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | XS2530208490              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | EUR                | 4 000.0                        | 17 613 968.1              | 0.8                                  | 0.9              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | XS2778272471              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | EUR                | 4 500.0                        | 19 905 652.1              | 0.9                                  | 1.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500450              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 3 000.0                        | 3 090 236.3               | 0.1                                  | 0.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500468              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 48 000.0                       | 48 265 189.6              | 2.3                                  | 2.5              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500476              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 10 000.0                       | 9 552 886.2               | 0.4                                  | 0.5              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500328              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 13 573.0                       | 13 514 615.9              | 0.6                                  | 0.7              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA      | PLB200000366              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 30.0                           | 15 319 173.3              | 0.7                                  | 0.8              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL00000113783             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 48 045.0                       | 39 150 429.1              | 1.9                                  | 2.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL00000119087             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 69 000.0                       | 65 481 690.0              | 3.1                                  | 3.4              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL00000109427             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1.0                            | 992.8                     | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL00000112736             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 10 112.0                       | 8 649 905.9               | 0.4                                  | 0.4              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL00000115291             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 132 200.0                      | 139 328 224.0             | 6.6                                  | 7.3              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL00000116851             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 12 000.0                       | 11 691 000.0              | 0.6                                  | 0.6              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA      | PL00000118188             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 136 000.0                      | 130 770 800.0             | 6.2                                  | 6.9              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTIMENT SA        | PL0017000079              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 266.0                          | 2 737 587.3               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTIMENT SA        | PL0017000111              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 337.0                          | 3 501 645.0               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTIMENT SA        | PL0017000137              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | EUR                | 1 862.0                        | 8 340 316.3               | 0.4                                  | 0.4              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500443              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 60 000.0                       | 62 783 080.5              | 3.0                                  | 3.3              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                        | PL0000500278              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 2 291.0                        | 2 036 845.6               | 0.1                                  | 0.1              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj rynek | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------|-----------------------|---------------|------------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GHEIAMCO INVEST SP ZOO         | PLGHLMC00560              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 5 595.0                       | 3 980 618.7               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ         | PL0326300079              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 166.0                         | 169 590.4                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ         | PL0326300095              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 704.0                         | 720 065.3                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | STATE OF ISRAEL                | IL0012035791              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | IL            | IL         | ILS                | 25 000 000.0                  | 31 588 322.4              | 1.5                                  | 1.7              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117743              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 77 000.0                      | 79 624 930.0              | 3.8                                  | 4.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117024              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 32 000.0                      | 31 191 360.0              | 1.5                                  | 1.6              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KEMBERTON SP ZOO               | PL0453600010              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 580.0                         | 531 300.3                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MBANK                          | XS3244863729              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | EUR                | 10.0                          | 4 355 660.9               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MOL GROUP                      | PL0048000015              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | HU            | HU         | PLN                | 1 590.0                       | 1 609 176.6               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PL0198500038              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 1 218.0                       | 1 236 480.0               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | Orlen SA                       | PL0037100016              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 66.0                          | 5 714 338.5               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | PL0046700012              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 10.0                          | 5 101 192.5               | 0.2                                  | 0.3              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | PL0046700038              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 2.0                           | 1 018 882.6               | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | XS2965663656              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | EUR                | 1 750.0                       | 7 706 311.0               | 0.4                                  | 0.4              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | XS3105979457              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | EUR                | 2 000.0                       | 8 568 932.2               | 0.4                                  | 0.4              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | JP561600AS27              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | JPY                | 20.0                          | 48 505 992.6              | 2.3                                  | 2.5              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117370              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 29 000.0                      | 29 630 750.0              | 1.4                                  | 1.6              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118519              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 149 000.0                     | 146 767 980.0             | 7.0                                  | 7.7              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000114393              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 1 970.0                       | 1 993 955.2               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000115192              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 1 848.0                       | 1 956 810.2               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000116760              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 20 600.0                      | 20 504 828.0              | 1.0                                  | 1.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117990              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 164 000.0                     | 159 393 240.0             | 7.6                                  | 8.4              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118998              | N/D                        | Obligacje       | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 277 000.0                     | 258 319 120.0             | 12.2                                 | 13.6             |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta         | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu     | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj rynek | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfolio | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------|-----------------------|---------------|------------|--------------------|--------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000113460              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 551.0                          | 551 242.4                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000119426              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 30 000.0                       | 29 832 300.0              | 1.4                                  | 1.6              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | WĘGRY                  | XS3435288413              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | HU            | HU         | EUR                | 5 000.0                        | 20 960 531.9              | 1.0                                  | 1.1              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RUMUNIA                | XS2571922884              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | RO            | RO         | USD                | 5 350.0                        | 41 805 312.8              | 2.0                                  | 2.2              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RUMUNIA                | XS2538441598              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | RO            | RO         | EUR                | 10 200.0                       | 46 706 674.7              | 2.2                                  | 2.5              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA  | XS3200021684              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | PL            | PL         | EUR                | 40.0                           | 17 449 419.2              | 0.8                                  | 0.9              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SOBIESKI TOWERS SP ZOO | PL0460200010              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 10 202.0                       | 10 968 592.6              | 0.5                                  | 0.6              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000105391              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 15 000.0                       | 15 567 150.0              | 0.7                                  | 0.8              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000117198              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 75 000.0                       | 73 293 750.0              | 3.5                                  | 3.8              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE          | PL0336300010              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 62.0                           | 637 553.4                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE          | PL0336300028              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 62.0                           | 639 693.3                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE          | PL0336300036              | N/D                        | Obligacje           | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 62.0                           | 641 854.0                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000118519              | N/D                        | Zobowiązania Repo   | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 0.0                            | -24 095 304.1             | 0.0                                  | -1.3             |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000117990              | N/D                        | Zobowiązania Repo   | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 0.0                            | -158 647 266.5            | 0.0                                  | -8.3             |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000117370              | N/D                        | Aktywa Reverse Repo | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 0.0                            | -1.5                      | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA  | PL0000118998              | N/D                        | Aktywa Reverse Repo | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 0.0                            | -0.2                      | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CBOT (T NOTE 10Y)      |                           | N/D                        | Kontrakt terminowy  | N/D                   |               |            | USD                | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 2.3              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | FX Swap             | N/D                   |               |            |                    | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | FX Swap             | N/D                   |               |            |                    | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | Swap walutowy       | N/D                   |               |            | PLN                | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | Swap walutowy       | N/D                   |               |            | ILS                | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                        |                           | N/D                        | Spot-Forward        | N/D                   |               |            |                    | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                     | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj rynek | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------------------|---------------|------------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                               |                           | N/D                        | Spot-Forward                        | N/D                   |               |            |                    | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                               |                           | N/D                        | Spot-Forward                        | N/D                   |               |            |                    | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                               |                           | N/D                        | IRS                                 | N/D                   |               |            | PLN                | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO035                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2030 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                               |                           | N/D                        | Gotówka/<br>Depozyty/<br>Należności | N/D                   |               |            | PLN                | 0.0                           | 26 265 417.7              | 1.2                                  | 1.4              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ALIOR BANK SA                 | PLALIOR00045              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 70 966.0                      | 9 772 018.2               | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ALLEGRO.EU SA                 | LU2237380790              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 776 064.0                     | 39 292 120.3              | 1.9                                  | 1.9              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BANK PEKAO                    | PLPEKAO00016              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 139 821.0                     | 39 275 718.9              | 1.9                                  | 1.9              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BUDIMEX SA                    | PLBUDMX00013              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 10 513.0                      | 7 037 402.2               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC0000016              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 41 305.0                      | 3 548 099.5               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CD PROJEKT SA                 | PLOPTIC00011              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 56 635.0                      | 14 385 290.0              | 0.7                                  | 0.7              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | DINO POLSKA SA                | PLDINPL00011              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 388 303.0                     | 13 617 786.2              | 0.7                                  | 0.7              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ENEA SA                       | PLENEA000013              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 12 803.0                      | 274 496.3                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA         | PLBZ00000044              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 33 143.0                      | 26 448 114.0              | 1.3                                  | 1.3              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GLOBE TRADE CENTRE SA         | PLGTC0000037              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 11 201.0                      | 26 434.4                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GRUPA AZOTY SA                | PLZATRM00012              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 2 930.0                       | 55 875.1                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GRUPA KETY SA                 | PLKETY000011              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 8 140.0                       | 10 288 960.0              | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA          | PLKGHM000017              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 109 967.0                     | 36 239 624.9              | 1.8                                  | 1.8              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KRUK SA                       | PLKRK0000010              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 13 824.0                      | 5 190 912.0               | 0.2                                  | 0.3              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | LPP SA                        | PLLPP0000011              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 1 006.0                       | 24 989 040.0              | 1.2                                  | 1.2              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | Orlen SA                      | PLPKN0000018              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 384 420.0                     | 56 148 385.2              | 2.7                                  | 2.8              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA | PLPGER000010              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 711 875.0                     | 10 777 787.5              | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKP CARGO SA                  | PLPKPCR00011              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | PL            | PL         | PLN                | 1 850.0                       | 18 851.5                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PEPCO GROUP NV.               | NL0015000AU7              | N/D                        | Akcje                               | N/D                   | GB            | GB         | PLN                | 166 670.0                     | 7 483 483.0               | 0.4                                  | 0.4              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                 | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryngła | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfolio | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|--------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI 8 | PLPKO0000016              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 540 866.0                      | 67 067 384.0              | 3.2                                  | 3.3              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PZU                            | PLPZU0000011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 448 976.0                      | 32 011 988.8              | 1.6                                  | 1.6              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLTAURN00011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 814 837.0                      | 7 512 797.1               | 0.4                                  | 0.4              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ZABKA GROUP SA                 | LU2910446546              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | LU            | PL          | PLN                | 414 496.0                      | 13 118 798.4              | 0.6                                  | 0.7              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MBANK                          | PLBRE0000012              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 10 714.0                       | 15 744 223.0              | 0.8                                  | 0.8              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ISHARES CORE MSCI WORLD        | IE0084LSY983              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO          | USD                | 368 977.0                      | 208 091 933.6             | 10.1                                 | 10.2             |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | AKCJI MAŁYCH I ŚREDNICH SPOLEK | AI0992351914              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 1 381.1                        | 977 951.9                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | AKCJI RYNKOW WSCHODZĄCYCH      | AI0992351941              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 3 039.3                        | 548 282.9                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SKARBOWY                       | AI0992351905              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 231.0                          | 690 177.5                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | XTRACKERS MSCI WORLD UCITS ETF | IE00BJ0KDQ92              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO          | USD                | 347 793.0                      | 214 611 931.3             | 10.4                                 | 10.6             |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                            | PL0000500468              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 38 200.0                       | 38 411 046.7              | 1.9                                  | 1.9              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                            | PL0000500328              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 5 675.0                        | 5 650 589.0               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000113783              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 61 812.0                       | 50 368 744.4              | 2.4                                  | 2.5              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000109427              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 77 001.0                       | 76 448 902.8              | 3.7                                  | 3.8              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000111498              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 933.0                          | 890 800.4                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000112736              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 253.0                          | 216 418.7                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000115291              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 119 663.0                      | 126 115 229.0             | 6.1                                  | 6.2              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000116851              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 104 979.0                      | 102 275 790.8             | 4.9                                  | 5.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118188              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 60 541.0                       | 58 213 198.6              | 2.8                                  | 2.9              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA             | PL0017000079              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 135.0                          | 1 389 377.0               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA             | PL0017000137              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 799.0                          | 3 578 900.5               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                            | PL0000500278              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 36 439.0                       | 32 396 602.1              | 1.6                                  | 1.6              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu    | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryglyka | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------|--------------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GHEIAMCO INVEST SP ZOO         | PLGHLMC00560              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 2 432.0                       | 1 730 270.7               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ         | PL0326300079              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 73.0                          | 74 578.9                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GMINA MIASTO GRUDZIADZ         | PL0326300095              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 310.0                         | 317 074.2                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000092              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 11.0                          | 10 820 004.5              | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000050              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 3.0                           | 2 675 248.0               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PL0198500038              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 536.0                         | 544 132.4                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | Orlen SA                       | PL0037100016              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 28.0                          | 2 424 264.8               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | PL0046700012              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 6.0                           | 3 060 715.5               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117370              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 141 100.0                     | 144 168 925.0             | 7.0                                  | 7.1              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118519              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 79 000.0                      | 77 816 580.0              | 3.8                                  | 3.8              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000114393              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 239.0                         | 241 906.2                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000115192              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 87 240.0                      | 92 376 691.2              | 4.5                                  | 4.5              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000116760              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 97 516.0                      | 97 065 476.1              | 4.7                                  | 4.8              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118998              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 152 900.0                     | 142 588 424.0             | 6.9                                  | 7.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000119426              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 21 700.0                      | 21 578 697.0              | 1.0                                  | 1.1              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SOBIESKI TOWERS SP ZOO         | PL0460200010              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 9 025.0                       | 9 703 151.1               | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000107611              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 127.0                         | 124 834.6                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000105391              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 67 925.0                      | 70 493 244.2              | 3.4                                  | 3.5              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PL0336300010              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 27.0                          | 277 644.2                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PL0336300028              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 27.0                          | 278 576.1                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PL0336300036              | N/D                        | Obligacje          | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 27.0                          | 279 517.0                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117370              | N/D                        | Zobowiązania Repo  | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 0.0                           | -12 622 394.3             | 0.0                                  | -0.6             |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GPW SA (WIG20)                 |                           | N/D                        | Kontrakt terminowy | N/D                   |               |              | PLN                | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | -4.1             |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                 | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryngła | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfolio | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|--------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                               |                           | N/D                        | Spot-Forward                    | N/D                   |               |             |                    | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                               |                           | N/D                        | Spot-Forward                    | N/D                   |               |             |                    | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC000016               | N/D                        | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA | PLPGER000010              | N/D                        | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 0.0                            | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO036                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2040 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                               |                           | N/D                        | Gotówka/ Depozyty/ Należności   | N/D                   |               |             | PLN                | 0.0                            | 26 556 500.9              | 1.3                                  | 1.3              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ALIOR BANK SA                 | PLALIOR00045              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 65 697.0                       | 9 046 476.9               | 0.7                                  | 0.7              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ALLEGRO.EU SA                 | LU2237380790              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 738 388.0                      | 37 384 584.4              | 2.8                                  | 2.8              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BANK PEKAO                    | PLPEKA000016              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 128 166.0                      | 36 001 829.4              | 2.7                                  | 2.7              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BUDIMEX SA                    | PLBUDMX00013              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9 518.0                        | 6 371 349.2               | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC000016               | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 37 786.0                       | 3 245 817.4               | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CD PROJEKT SA                 | PLOPTC00011               | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 51 922.0                       | 13 188 188.0              | 1.0                                  | 1.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | DINO POLSKA SA                | PLDINPL00011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 344 320.0                      | 12 075 302.4              | 0.9                                  | 0.9              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ENEA SA                       | PLENEA000013              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 822.0                        | 167 703.7                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA         | PLBZ00000044              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 30 716.0                       | 24 511 368.0              | 1.8                                  | 1.9              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GLOBE TRADE CENTRE SA         | PLGTC0000037              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 842.0                        | 16 147.1                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GRUPA AZOTY SA                | PLZATRM00012              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 789.0                        | 34 116.2                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GRUPA KETY SA                 | PLKETY000011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 7 384.0                        | 9 333 376.0               | 0.7                                  | 0.7              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA          | PLKGHM000017              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 100 599.0                      | 33 152 400.4              | 2.5                                  | 2.5              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KRUK SA                       | PLKRK0000010              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 12 933.0                       | 4 856 341.5               | 0.4                                  | 0.4              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | LPP SA                        | PLLPP0000011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 939.0                          | 23 324 760.0              | 1.7                                  | 1.8              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | Orlen SA                      | PLPKN0000018              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 370 201.0                      | 54 071 558.1              | 4.0                                  | 4.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA | PLPGER000010              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 658 688.0                      | 9 972 536.3               | 0.7                                  | 0.8              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                 | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryngła | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfolio | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|--------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKP CARGO SA                   | PLPKCR00011               | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 129.0                        | 11 504.5                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PEPCO GROUP N.V.               | NL0015000AU7              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 154 468.0                      | 6 935 613.2               | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI 8 | PLPKO0000016              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 515 035.0                      | 63 864 340.0              | 4.7                                  | 4.8              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PZU                            | PLPZU0000011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 414 138.0                      | 29 528 039.4              | 2.2                                  | 2.2              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLTAURN00011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 777 205.0                      | 7 165 830.1               | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ZABKA GROUP SA                 | LU2910446546              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | LU            | PL          | PLN                | 382 155.0                      | 12 095 205.8              | 0.9                                  | 0.9              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MBANK                          | PLBRE0000012              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9 789.0                        | 14 384 935.5              | 1.1                                  | 1.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ISHARES CORE MSCI WORLD        | IE0084LSY983              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO          | USD                | 358 319.0                      | 202 081 142.1             | 14.9                                 | 15.2             |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | AKCJI RYNKOW WSKHODZACYCH      | AI0992351941              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 2 653.7                        | 478 721.2                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | XTRACKERS MSCI WORLD UCITS ETF | IE00BJ0KDQ92              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO          | USD                | 337 410.0                      | 208 204 914.2             | 15.4                                 | 15.7             |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                            | PL0000500468              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 11 000.0                       | 11 060 772.6              | 0.8                                  | 0.8              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                            | PL0000500328              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 1 831.0                        | 1 823 124.0               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000113783              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 23 983.0                       | 19 543 027.2              | 1.4                                  | 1.5              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000109427              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 50 655.0                       | 50 291 803.6              | 3.7                                  | 3.8              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000111498              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 16.0                           | 15 276.3                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000112736              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 439.0                          | 375 525.0                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000115291              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 51 462.0                       | 54 236 831.0              | 4.0                                  | 4.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000116851              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 42 062.0                       | 40 978 903.5              | 3.0                                  | 3.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118188              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 37 789.0                       | 36 336 013.0              | 2.7                                  | 2.7              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA             | PL0017000079              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 43.0                           | 442 542.3                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA             | PL0017000137              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 237.0                          | 1 061 576.2               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                            | PL0000500278              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 22 030.0                       | 19 586 079.3              | 1.4                                  | 1.5              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO         | PLGHLMC00560              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 757.0                          | 538 575.2                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu   | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryglyka | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfolio | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|-------------------|-----------------------|---------------|--------------|--------------------|--------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GINA MIASTO GRUDZIADZ          | PL0326300079              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 22.0                           | 22 475.8                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GINA MIASTO GRUDZIADZ          | PL0326300095              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 95.0                           | 97 167.9                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000092              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 4.0                            | 3 934 547.1               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POLSKI FUNDUSZ ROZWOJU SA      | PLPFR0000050              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1.0                            | 891 749.3                 | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PL0198500038              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 164.0                          | 166 488.3                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | Orlen SA                       | PL0037100016              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 9.0                            | 779 228.0                 | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | PL0046700012              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 2.0                            | 1 020 238.5               | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000117370             | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 60 668.0                       | 61 987 529.0              | 4.6                                  | 4.7              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000118519             | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 14 000.0                       | 13 790 280.0              | 1.0                                  | 1.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000114393             | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 194.0                          | 196 359.0                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000115192             | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 34 125.0                       | 36 134 280.0              | 2.7                                  | 2.7              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000116760             | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 35 436.0                       | 35 272 285.7              | 2.6                                  | 2.7              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000118998             | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 91 100.0                       | 84 956 216.0              | 6.3                                  | 6.4              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000119426             | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 14 300.0                       | 14 220 063.0              | 1.0                                  | 1.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SOBIESKI TOWERS SP ZOO         | PL0460200010              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 3 959.0                        | 4 256 484.8               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | TARNOW                         | PL0266300071              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 24.0                           | 24 662.7                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000107611             | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 595.0                          | 584 855.2                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000105391             | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 13 910.0                       | 14 435 937.1              | 1.1                                  | 1.1              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PL0336300010              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 8.0                            | 82 265.0                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PL0336300028              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 8.0                            | 82 541.1                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PL0336300036              | N/D                        | Obligacje         | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 8.0                            | 82 819.9                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000115291             | N/D                        | Zobowiązania Repo | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 0.0                            | -3 871 736.6              | 0.0                                  | -0.3             |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                 | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryglyka | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|-------------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|---------------|--------------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA         | PL0000117370              | N/D                        | Zobowiązania Repo               | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 0.0                           | -9 770 579.1              | 0.0                                  | -0.7             |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GPW SA (WIG20)                |                           | N/D                        | Kontrakt terminowy              | N/D                   |               |              | PLN                | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | -4.4             |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                               |                           | N/D                        | Spot-Forward                    | N/D                   |               |              |                    | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC0000016              | N/D                        | Pożyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO037                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2050 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                               |                           | N/D                        | Gatówka/ Depozyty/ Należności   | N/D                   |               |              | PLN                | 0.0                           | 22 222 462.4              | 1.6                                  | 1.7              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ALIOR BANK SA                 | PLALIOR00045              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 42 983.0                      | 5 918 759.1               | 0.9                                  | 0.9              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ALLEGRO.EU SA                 | LU2237380790              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 488 505.0                     | 24 733 008.1              | 3.8                                  | 3.9              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BANK PEKAO                    | PLPEKAO00016              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 84 225.0                      | 23 658 802.5              | 3.6                                  | 3.7              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BUDIMEX SA                    | PLBUDMX00013              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 6 204.0                       | 4 152 957.6               | 0.6                                  | 0.7              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CCC SA                        | PLCCC0000016              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 23 656.0                      | 2 032 050.4               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CD PROJEKT SA                 | PLOPTIC00011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 34 213.0                      | 8 690 102.0               | 1.3                                  | 1.4              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | DINO POLSKA SA                | PLDINPL00011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 231 866.0                     | 8 131 540.6               | 1.2                                  | 1.3              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ENEA SA                       | PLENEA000013              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 3 966.0                       | 85 031.0                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA         | PLBZ00000044              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 20 190.0                      | 16 111 620.0              | 2.5                                  | 2.5              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GLOBE TRADE CENTRE SA         | PLGTC0000037              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 3 622.0                       | 8 547.9                   | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GRUPA AZOTY SA                | PLZATRM00012              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 947.0                         | 18 059.3                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GRUPA KETY SA                 | PLKETY000011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 4 733.0                       | 5 982 512.0               | 0.9                                  | 0.9              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA          | PLKGHM000017              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 66 445.0                      | 21 896 949.8              | 3.4                                  | 3.4              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KRUK SA                       | PLKRK0000010              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 8 495.0                       | 3 189 872.5               | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | LPP SA                        | PLLPP0000011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 615.0                         | 15 276 600.0              | 2.4                                  | 2.4              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | Orlen SA                      | PLPKN0000018              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 243 231.0                     | 35 526 319.9              | 5.5                                  | 5.5              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA | PLPGER000010              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 431 084.0                     | 6 526 611.8               | 1.0                                  | 1.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKP CARGO SA                  | PLPKPCR00011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 597.0                         | 6 083.4                   | 0.0                                  | 0.0              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                 | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryngła | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfolio | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|--------------------|--------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PEPCO GROUP NV.                | NL0015000AU7              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | GB            | GB          | PLN                | 97 042.0                       | 4 357 185.8               | 0.7                                  | 0.7              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI 8 | PLPKO0000016              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 339 538.0                      | 42 102 712.0              | 6.5                                  | 6.6              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PZU                            | PLPZU0000011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 275 227.0                      | 19 623 685.1              | 3.0                                  | 3.1              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLTAURN00011              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 508 619.0                      | 4 689 467.2               | 0.7                                  | 0.7              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ZABKA GROUP SA                 | LU2910446546              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | LU            | PL          | PLN                | 249 081.0                      | 7 883 413.6               | 1.2                                  | 1.2              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MBANK                          | PLBRE0000012              | N/D                        | Akcje                           | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 270.0                        | 9 213 765.0               | 1.4                                  | 1.4              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ISHARES CORE MSCI WORLD        | IE0084LSY983              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO          | USD                | 213 709.0                      | 120 525 450.2             | 18.5                                 | 18.8             |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | AKCJI RYNKOW WSCHODZACYCH      | AI0992351941              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | PL            |             | PLN                | 1 323.4                        | 238 738.1                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | XTRACKERS MSCI WORLD UCITS ETF | IE008J0KDQ92              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO          | USD                | 201 487.0                      | 124 331 180.3             | 19.1                                 | 19.4             |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                            | PL0000500468              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 500.0                          | 502 762.4                 | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                            | PL0000500328              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 252.0                          | 250 916.0                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000113783             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 3 819.0                        | 3 111 988.5               | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000109427             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 8 638.0                        | 8 576 065.5               | 1.3                                  | 1.3              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000111498             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 100.0                          | 95 477.0                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000112736             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 376.0                          | 321 634.2                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000115291             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9 584.0                        | 10 100 769.3              | 1.6                                  | 1.6              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000116851             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 9 137.0                        | 8 901 722.2               | 1.4                                  | 1.4              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL00000118188             | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6 570.0                        | 6 317 383.5               | 1.0                                  | 1.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA             | PL0017000079              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 6.0                            | 61 750.1                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ECHO INVESTMENT SA             | PL0017000137              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | EUR                | 32.0                           | 143 335.2                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                            | PL0000500278              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 2 257.0                        | 2 006 617.4               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GHELAMCO INVEST SP ZOO         | PLGHLMCO0560              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL          | PLN                | 101.0                          | 71 857.5                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                 | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryglyka | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|---------------|--------------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GINA MIASTO GRUDZIADZ          | PL0326300079              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 3.0                           | 3 064.9                   | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GINA MIASTO GRUDZIADZ          | PL0326300095              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 13.0                          | 13 296.7                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POLSKI HOLDING NIERUCHOMOSCI S | PL0198500038              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 22.0                          | 22 333.8                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | Orlen SA                       | PL0037100016              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1.0                           | 86 580.9                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PKO BP                         | PL0046700012              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1.0                           | 510 119.2                 | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117370              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 4 953.0                       | 5 060 727.8               | 0.8                                  | 0.8              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118519              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 4 000.0                       | 3 940 080.0               | 0.6                                  | 0.6              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000114393              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 181.0                         | 183 201.0                 | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000115192              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 7 000.0                       | 7 412 160.0               | 1.1                                  | 1.2              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000116760              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 6 160.0                       | 6 131 540.8               | 0.9                                  | 1.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118998              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 19 900.0                      | 18 557 944.0              | 2.9                                  | 2.9              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000119426              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 3 600.0                       | 3 579 876.0               | 0.6                                  | 0.6              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SOBIESKI TOWERS SP ZOO         | PL0460200010              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 681.0                         | 732 171.3                 | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | TARNOW                         | PL0266300071              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 3.0                           | 3 082.8                   | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000105391              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 2 035.0                       | 2 111 943.4               | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PL0336300010              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1.0                           | 10 283.1                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PL0336300028              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1.0                           | 10 317.6                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MIASTO ZABRZE                  | PL0336300036              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1.0                           | 10 352.5                  | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117990              | N/D                        | Aktywa Reverse Repo             | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 0.0                           | 26 989 234.7              | 4.2                                  | 4.2              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CME S&P 500 MINI               |                           | N/D                        | Kontrakt terminowy              | N/D                   |               |              | USD                | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | 5.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GPW SA (WIG20)                 |                           | N/D                        | Kontrakt terminowy              | N/D                   |               |              | PLN                | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | -4.2             |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                                |                           | N/D                        | Spot-Forward                    | N/D                   |               |              |                    | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CCC SA                         | PLCCC0000016              | N/D                        | Pozyczki papierów wartościowych | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu             | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryglyka | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------|---------------|--------------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO038                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2060 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                                |                           | N/D                        | Gotówka/Depozyty/Należności | N/D                   |               |              | PLN                | 0.0                           | 18 046 214.6              | 2.8                                  | 2.8              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ALIOR BANK SA                  | PLALIOR00045              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 3 856.0                       | 530 971.2                 | 0.8                                  | 0.9              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ALLEGRO.EU SA                  | LU2237380790              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 43 826.0                      | 2 218 910.4               | 3.5                                  | 3.6              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BANK PEKAO                     | PLPEKAO00016              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 7 556.0                       | 2 122 480.4               | 3.4                                  | 3.5              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BUDIMEX SA                     | PLBUDMX00013              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 557.0                         | 372 855.8                 | 0.6                                  | 0.6              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CCC SA                         | PLCCC0000016              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1 890.0                       | 162 351.0                 | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CD PROJEKT SA                  | PLOPTIC00011              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 3 069.0                       | 779 526.0                 | 1.2                                  | 1.3              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | DINO POLSKA SA                 | PLDINPL00011              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 20 802.0                      | 729 526.1                 | 1.2                                  | 1.2              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SANTANDER BANK POLSKA          | PLBZ00000044              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1 811.0                       | 1 445 178.0               | 2.3                                  | 2.4              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GRUPA KETY SA                  | PLKETY000011              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 425.0                         | 537 200.0                 | 0.9                                  | 0.9              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KGHM POLSKA MIEDZ SA           | PLKGHM000017              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 5 961.0                       | 1 964 447.6               | 3.1                                  | 3.2              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | KRUK SA                        | PLKRK0000010              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 762.0                         | 286 131.0                 | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | LPP SA                         | PLLPP0000011              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 55.0                          | 1 366 200.0               | 2.2                                  | 2.2              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MERCATOR MEDICAL SA            | PLMRCR000015              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 10.0                          | 604.0                     | 0.0                                  | 0.0              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | Orlen SA                       | PLPKN0000018              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 21 117.0                      | 3 084 349.0               | 4.9                                  | 5.0              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA  | PLPGER0000010             | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 38 674.0                      | 585 524.4                 | 0.9                                  | 0.9              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PEPCO GROUP NV.                | NL0015000AU7              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | GB            | GB           | PLN                | 7 753.0                       | 348 109.7                 | 0.6                                  | 0.6              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI B | PLPKO0000016              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 27 419.0                      | 3 399 956.0               | 5.4                                  | 5.5              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | PZU                            | PLPZU0000011              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 24 692.0                      | 1 760 539.6               | 2.8                                  | 2.9              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | TAURON POLSKA ENERGIA SA       | PLTAURN00011              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 45 630.0                      | 420 708.6                 | 0.7                                  | 0.7              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ZABKA GROUP SA                 | LU2910446546              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | LU            | PL           | PLN                | 22 346.0                      | 707 250.9                 | 1.1                                  | 1.1              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | MBANK                          | PLBRE0000012              | N/D                        | Akcje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 562.0                         | 825 859.0                 | 1.3                                  | 1.3              |                          |

# Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30

(continued)

| Identyfikator funduszu | Nazwa funduszu                              | Typ funduszu | Standardowy identyfikator funduszu | Waluta wyceny funduszu | Nazwa emitenta                 | Identyfikator instrumentu | Alternatywny identyfikator | Typ instrumentu                 | Kategoria instrumentu | Kraj emitenta | Kraj ryglyka | Waluta instrumentu | Ileść instrumentów w portfelu | Wartość instrumentu w PLN | Udział w wartości aktywów ogółem (%) | Udział w NAV (%) | Informacje uzupełniające |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------|----------------------------|---------------------------------|-----------------------|---------------|--------------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------|--------------------------|
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | ISHARES CORE MSCI WORLD        | IE00B4LSY983              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO           | USD                | 20 985.0                      | 11 834 909.0              | 18.9                                 | 19.2             |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | XTRACKERS MSCI WORLD UCITS ETF | IE00BJ0KDQ92              | N/D                        | Tytuły i jednostki uczestnictwa | N/D                   | IE            | GO           | USD                | 19 028.0                      | 11 741 569.9              | 18.7                                 | 19.1             |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | BGK                            | PL0000500468              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 300.0                         | 301 657.4                 | 0.5                                  | 0.5              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000113783              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 260.0                         | 211 866.2                 | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000109427              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1 162.0                       | 1 153 668.5               | 1.8                                  | 1.9              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000115291              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 1 208.0                       | 1 273 135.4               | 2.0                                  | 2.1              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000116851              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 693.0                         | 675 155.2                 | 1.1                                  | 1.1              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118188              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 200.0                         | 192 310.0                 | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117370              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 204.0                         | 208 437.0                 | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118519              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 800.0                         | 788 016.0                 | 1.3                                  | 1.3              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000114393              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 200.0                         | 202 432.0                 | 0.3                                  | 0.3              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000115192              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 500.0                         | 529 440.0                 | 0.8                                  | 0.9              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000116760              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 154.0                         | 153 288.5                 | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000118998              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 2 400.0                       | 2 238 144.0               | 3.6                                  | 3.6              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000119426              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 400.0                         | 397 764.0                 | 0.6                                  | 0.7              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | SOBIESKI TOWERS SP ZOO         | PL0460200010              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 62.0                          | 66 658.8                  | 0.1                                  | 0.1              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000107611              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 100.0                         | 98 295.0                  | 0.2                                  | 0.2              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000105391              | N/D                        | Obligacje                       | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 355.0                         | 368 422.6                 | 0.6                                  | 0.6              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | RZECZPOSPOLITA POLSKA          | PL0000117198              | N/D                        | Aktywa Reverse Repo             | N/D                   | PL            | PL           | PLN                | 0.0                           | 1 660 640.6               | 2.6                                  | 2.7              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | CME S&P 500 MINI               |                           | N/D                        | Kontrakt terminowy              | N/D                   |               |              | USD                | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | 4.8              |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    | GPW SA (WIG20)                 |                           | N/D                        | Kontrakt terminowy              | N/D                   |               |              | PLN                | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | -0.9             |                          |
| PKO076                 | Subfundusz Zabezpieczenia Emerytalnego 2070 | SFIO         | N/D                                | PLN                    |                                |                           | N/D                        | Spot-Forward                    | N/D                   |               |              |                    | 0.0                           | 0.0                       | 0.0                                  | 0.0              |                          |

## Skład portfela dla funduszu PKO Zabezpieczenia Emerytalnego SFIO na dzień 2026-09-30



|        |                                                   |      |     |     |     |                                     |     |     |     |             |     |     |
|--------|---------------------------------------------------|------|-----|-----|-----|-------------------------------------|-----|-----|-----|-------------|-----|-----|
| PKO076 | Subfundusz<br>Zabezpieczenia<br>Emerytalnego 2070 | SFIO | N/D | PLN | N/D | Gotówka/<br>Depozyty/<br>Należności | N/D | PLN | 0.0 | 4 368 902.1 | 7.0 | 7.1 |
|--------|---------------------------------------------------|------|-----|-----|-----|-------------------------------------|-----|-----|-----|-------------|-----|-----|

*Plik „Skład portfela” prezentuje dane w ujęciu ekonomicznym - mogą się one nieznacznie różnić od ujęcia księgowego stosowanego w sprawozdaniach finansowych funduszy. Ewentualne różnice mogą wynikać w szczególności z różnych dat ujęcia transakcji na potrzeby wyceny jednostki funduszu oraz na potrzeby sprawozdania finansowego funduszu. Ponadto sprawozdanie finansowe funduszu może uwzględniać korekty oraz informacje ujawnione po okresie sprawozdawczym.*