

TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 28 czerwca 2024 r.
(wg stanu na 25 czerwca 2024 r.)

TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on June 28, 2024)
(on June 25, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115291	DS1033	50 288 338	9,2182
2	PL0000115192	PS0728	45 507 599	8,9684
3	PL0000105391	WS0429	48 800 984	8,5829
4	PL0000111498	DS1029	52 504 201	8,0931
5	PL0000108866	DS0726	46 304 794	7,7524
6	PL0000108197	DS0725	38 428 531	6,6964
7	PL0000112736	DS1030	47 019 530	6,3497
8	PL0000109427	DS0727	38 233 882	6,2228
9	PL0000107611	WS0428	38 280 416	6,0437
10	PL0000113783	DS0432	42 705 386	5,6126
11	PL0000114393	PS0527	32 829 594	5,4452
12	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,1905
13	PL0000116760	PS0729	24 751 448	4,3027
14	PL0000112728	PS0425	25 727 940	4,2919
15	PL0000115283	OK1025	25 120 407	4,0559
16	PL0000116596	OK0426	13 024 134	2,0502
17	PL0000116851	DS1034	6 670 128	1,1234

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 28 czerwca 2024 r.
(wg stanu na 25 czerwca 2024 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on June 28, 2024)
(on June 25, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	24,8548
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	21,4693
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	17,4579
4	PL0000113460	PS1026	33 624 153	16,6412
5	PL0000115283	OK1025	25 120 407	13,0037
6	PL0000116596	OK0426	13 024 134	6,5731

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 28 czerwca 2024 r.
(wg stanu na 25 czerwca 2024 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on June 28, 2024)
(on June 25, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	17,8391
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	15,4092
3	PL0000109427	DS0727	38 233 882	14,3193
4	PL0000107611	WS0428	38 280 416	13,9073
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	12,5301
6	PL0000113460	PS1026	33 624 153	11,9439
7	PL0000115283	OK1025	25 120 407	9,3332
8	PL0000116596	OK0426	13 024 134	4,7178

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 28 czerwca 2024 r.
(wg stanu na 25 czerwca 2024 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on June 28, 2024)
(on June 25, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	14,7003
2	PL0000105391	WS0429	48 800 984	14,0684
3	PL0000108866	DS0726	46 304 794	12,7071
4	PL0000108197	DS0725	38 428 531	10,9762
5	PL0000109427	DS0727	38 233 882	10,1999
6	PL0000107611	WS0428	38 280 416	9,9064
7	PL0000114393	PS0527	32 829 594	8,9254
8	PL0000113460	PS1026	33 624 153	8,5078
9	PL0000115283	OK1025	25 120 407	6,6482
10	PL0000116596	OK0426	13 024 134	3,3605

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 28 czerwca 2024 r.
(wg stanu na 25 czerwca 2024 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on June 28, 2024)
(on June 25, 2024)

Lp. <i>No</i>	Kod <i>ISIN code</i>	Nazwa <i>Name</i>	Liczba obligacji <i>Number of bonds</i>	Udział (%) <i>Share (%)</i>
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	30,0773
2	PL0000105391	WS0429	48 800 984	28,7845
3	PL0000109427	DS0727	38 233 882	20,8693
4	PL0000107611	WS0428	38 280 416	20,2689

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 28 czerwca 2024 r.
(wg stanu na 25 czerwca 2024 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on June 28, 2024)
(on June 25, 2024)

Lp. <i>No</i>	Kod <i>ISIN code</i>	Nazwa <i>Name</i>	Liczba obligacji <i>Number of bonds</i>	Udział (%) <i>Share (%)</i>
1	PL0000115291	DS1033	50 288 338	26,5655
2	PL0000111498	DS1029	52 504 201	23,3234
3	PL0000112736	DS1030	47 019 530	18,2991
4	PL0000113783	DS0432	42 705 386	16,1747
5	PL0000116760	PS0729	24 751 448	12,3997
6	PL0000116851	DS1034	6 670 128	3,2376

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 28 czerwca 2024 r.
(wg stanu na 25 czerwca 2024 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on June 28, 2024)
(on June 25, 2024)

Lp. <i>No</i>	Kod <i>ISIN code</i>	Nazwa <i>Name</i>	Liczba obligacji <i>Number of bonds</i>	Udział (%) <i>Share (%)</i>
1	PL0000111928	WZ1129	49 947 930	18,6349
2	PL0000115697	WZ1128	45 069 356	17,0039
3	PL0000114559	WZ1127	40 588 489	15,4517
4	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	11,2774
5	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	10,7263
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	9,0893
7	PL0000111738	WZ0525	23 243 493	8,9864
8	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	8,8301

po okresowej zmianie portfeli w dniu 28 czerwca 2024 r.
wg stanu na 25 czerwca 2024 r.
(after periodic change of index portfolio on June 28, 2024)
(on June 25, 2024)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	17	6	8	10	4	6	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	581 104,71	181 250,32	252 531,53	354 522,87	173 272,55	201 641,44	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,31%	5,06%	5,13%	5,21%	5,37%	5,56%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,84	1,89	2,29	2,75	3,64	6,13	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,64%	1,80%	2,17%	2,61%	3,45%	5,81%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,31	1,94	2,37	2,96	4,04	7,11	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,36%	2,02%	2,19%	3,47%	4,99%	3,50%	Coupon (%)