

TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 30 września 2024 r.
(wg stanu na 26 września 2024 r.)

TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on September 30, 2024)
(on September 26, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115291	DS1033	50 461 412	9,3044
2	PL0000105391	WS0429	48 800 984	8,6010
3	PL0000115192	PS0728	45 507 599	8,3832
4	PL0000111498	DS1029	52 504 201	8,1257
5	PL0000108866	DS0726	46 304 794	7,4743
6	PL0000116760	PS0729	43 622 821	7,2559
7	PL0000112736	DS1030	50 773 940	6,9169
8	PL0000109427	DS0727	42 482 132	6,7068
9	PL0000107611	WS0428	38 280 416	6,0416
10	PL0000113783	DS0432	44 172 770	5,8581
11	PL0000108197	DS0725	33 157 527	5,5357
12	PL0000114393	PS0527	32 829 594	5,4105
13	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,1412
14	PL0000115283	OK1025	25 120 407	4,0041
15	PL0000116851	DS1034	15 946 514	2,7083
16	PL0000116596	OK0426	16 266 370	2,5324

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 września 2024 r.
(wg stanu na 26 września 2024 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on September 30, 2024)
(on September 26, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	23,9029
2	PL0000109427	DS0727	42 482 132	21,4486
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	17,3028
4	PL0000113460	PS1026	33 624 153	16,4418
5	PL0000115283	OK1025	25 120 407	12,8052
6	PL0000116596	OK0426	16 266 370	8,0987

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 września 2024 r.
(wg stanu na 26 września 2024 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on September 30, 2024)
(on September 26, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	18,3463
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	16,3572
3	PL0000109427	DS0727	42 482 132	14,6777
4	PL0000107611	WS0428	38 280 416	13,2218
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	11,8406
6	PL0000113460	PS1026	33 624 153	11,2515
7	PL0000115283	OK1025	25 120 407	8,7629
8	PL0000116596	OK0426	16 266 370	5,5421

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 września 2024 r.
(wg stanu na 26 września 2024 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on September 30, 2024)
(on September 26, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000105391	WS0429	48 800 984	13,9738
2	PL0000115192	PS0728	45 507 599	13,6199
3	PL0000108866	DS0726	46 304 794	12,1433
4	PL0000116760	PS0729	43 622 821	11,7884
5	PL0000109427	DS0727	42 482 132	10,8964
6	PL0000107611	WS0428	38 280 416	9,8155
7	PL0000114393	PS0527	32 829 594	8,7902
8	PL0000113460	PS1026	33 624 153	8,3528
9	PL0000115283	OK1025	25 120 407	6,5054
10	PL0000116596	OK0426	16 266 370	4,1143

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 września 2024 r.
(wg stanu na 26 września 2024 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on September 30, 2024)
(on September 26, 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	PL0000105391	WS0429	48 800 984	28,4033
2	PL0000115192	PS0728	45 507 599	27,6841
3	PL0000116760	PS0729	43 622 821	23,9613
4	PL0000107611	WS0428	38 280 416	19,9513

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 września 2024 r.
(wg stanu na 26 września 2024 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on September 30, 2024)
(on September 26, 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	50 461 412	28,2694
2	PL0000111498	DS1029	52 504 201	24,6882
3	PL0000112736	DS1030	50 773 940	21,0154
4	PL0000113783	DS0432	44 172 770	17,7985
5	PL0000116851	DS1034	15 946 514	8,2285

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 30 września 2024 r.
(wg stanu na 26 września 2024 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on September 30, 2024)
(on September 26, 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	56 493 128	20,9603
2	PL0000115697	WZ1128	45 069 356	16,9176
3	PL0000114559	WZ1127	40 588 489	15,4003
4	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	11,2472
5	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	10,6665
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	8,9710
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	8,5570
8	PL0000111738	WZ0525	18 899 022	7,2803

po okresowej zmianie portfeli w dniu 30 września 2024 r.
 wg stanu na 26 września 2024 r.
 (after periodic change of index portfolio on September 30, 2024)
 (on September 26, 2024)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	16	6	8	10	4	5	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	598 946,86	187 286,56	273 683,08	368 657,17	181 370,61	197 133,82	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	4,87%	4,68%	4,73%	4,80%	4,92%	5,17%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,91	2,07	2,50	2,94	3,85	6,22	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,72%	1,98%	2,39%	2,81%	3,66%	5,91%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,38	2,11	2,62	3,16	4,23	7,28	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,49%	1,82%	2,99%	3,58%	5,40%	3,36%	Coupon (%)