

TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 29 lutego 2024 r.
(wg stanu na 26 lutego 2024 r.)

TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on February 29, 2024)
(on February 26, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	9,3600
2	PL0000105391	WS0429	45 471 977	8,8331
3	PL0000115291	DS1033	43 420 710	8,4025
4	PL0000108866	DS0726	46 304 794	8,0310
5	PL0000111498	DS1029	49 237 374	7,9791
6	PL0000108197	DS0725	38 428 531	6,9128
7	PL0000107611	WS0428	38 280 416	6,4978
8	PL0000112736	DS1030	43 507 898	6,2077
9	PL0000111720	PS1024	34 322 080	6,1494
10	PL0000114393	PS0527	32 829 594	5,8850
11	PL0000113783	DS0432	39 114 663	5,5724
12	PL0000109427	DS0727	31 971 360	5,4189
13	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,3823
14	PL0000112728	PS0425	29 888 503	5,1846
15	PL0000115283	OK1025	25 120 407	4,1833

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 29 lutego 2024 r.
(wg stanu na 26 lutego 2024 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on February 29, 2024)
(on February 26, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	27,0459
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	23,2802
3	PL0000113460	PS1026	33 624 153	18,1258
4	PL0000112728	PS0425	29 888 503	17,4601
5	PL0000115283	OK1025	25 120 407	14,0879

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 29 lutego 2024 r.
(wg stanu na 26 lutego 2024 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on February 29, 2024)
(on February 26, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	19,5889
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	16,8615
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	14,3543
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	13,2175
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	13,1282
6	PL0000112728	PS0425	29 888 503	12,6461
7	PL0000115283	OK1025	25 120 407	10,2036

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 29 lutego 2024 r.
(wg stanu na 26 lutego 2024 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on February 29, 2024)
(on February 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	PL0000115192	PS0728	45 507 599	16,4627
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	14,1253
3	PL0000108197	DS0725	38 428 531	12,1586
4	PL0000107611	WS0428	38 280 416	11,4287
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	10,3507
6	PL0000109427	DS0727	31 971 360	9,5310
7	PL0000113460	PS1026	33 624 153	9,4666
8	PL0000112728	PS0425	29 888 503	9,1189
9	PL0000115283	OK1025	25 120 407	7,3577

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 29 lutego 2024 r.
(wg stanu na 26 lutego 2024 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on February 29, 2024)
(on February 26, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	34,4602
2	PL0000107611	WS0428	38 280 416	23,9228
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	21,6664
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	19,9505

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 29 lutego 2024 r.
(wg stanu na 26 lutego 2024 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on February 29, 2024)
(on February 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	45 471 977	23,8765
2	PL0000115291	DS1033	43 420 710	22,7127
3	PL0000111498	DS1029	49 237 374	21,5681
4	PL0000112736	DS1030	43 507 898	16,7799
5	PL0000113783	DS0432	39 114 663	15,0626

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 29 lutego 2024 r.
(wg stanu na 26 lutego 2024 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on February 29, 2024)
(on February 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	PL0000115697	WZ1128	45 069 356	18,2881
2	PL0000114559	WZ1127	40 588 489	16,5508
3	PL0000111738	WZ0525	30 420 616	12,5717
4	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	12,0957
5	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	11,5040
6	PL0000111928	WZ1129	24 901 805	10,0202
7	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	9,7799
8	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	9,1896

wg stanu na 26 lutego 2024 r.
(on February 26, 2024)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	15	5	7	9	4	5	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	553 482,49	164 351,33	226 916,19	314 686,49	150 335,16	204 760,17	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,05%	4,98%	4,99%	5,00%	5,03%	5,18%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,81	1,87	2,22	2,67	3,54	6,08	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,62%	1,78%	2,11%	2,54%	3,37%	5,78%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,25	1,90	2,29	2,85	3,90	6,99	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,26%	1,61%	2,03%	3,02%	4,55%	3,80%	Coupon (%)