

TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2024 r.
(wg stanu na 26 lipca 2024 r.)

TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on July 31, 2024)
(on July 26, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115291	DS1033	50 288 338	9,2258
2	PL0000105391	WS0429	48 800 984	8,5611
3	PL0000115192	PS0728	45 507 599	8,3517
4	PL0000111498	DS1029	52 504 201	8,0825
5	PL0000108866	DS0726	46 304 794	7,5079
6	PL0000108197	DS0725	38 428 531	6,4603
7	PL0000112736	DS1030	47 019 530	6,3522
8	PL0000109427	DS0727	39 780 882	6,2799
9	PL0000107611	WS0428	38 280 416	6,0237
10	PL0000113783	DS0432	44 172 770	5,8118
11	PL0000114393	PS0527	32 829 594	5,4197
12	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,1588
13	PL0000116760	PS0729	29 965 999	4,9507
14	PL0000115283	OK1025	25 120 407	4,0391
15	PL0000112728	PS0425	24 177 717	4,0184
16	PL0000116596	OK0426	14 452 134	2,2584
17	PL0000116851	DS1034	8 893 308	1,4980

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2024 r.
(wg stanu na 26 lipca 2024 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2024)
(on July 26, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	24,4846
2	PL0000109427	DS0727	39 780 882	20,4799
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	17,6746
4	PL0000113460	PS1026	33 624 153	16,8238
5	PL0000115283	OK1025	25 120 407	13,1723
6	PL0000116596	OK0426	14 452 134	7,3649

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2024 r.
(wg stanu na 26 lipca 2024 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2024)
(on July 26, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	18,5432
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	16,6697
3	PL0000109427	DS0727	39 780 882	13,9432
4	PL0000107611	WS0428	38 280 416	13,3745
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	12,0333
6	PL0000113460	PS1026	33 624 153	11,4540
7	PL0000115283	OK1025	25 120 407	8,9680
8	PL0000116596	OK0426	14 452 134	5,0142

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2024 r.
(wg stanu na 26 lipca 2024 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2024)
(on July 26, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000105391	WS0429	48 800 984	14,6216
2	PL0000115192	PS0728	45 507 599	14,2640
3	PL0000108866	DS0726	46 304 794	12,8228
4	PL0000109427	DS0727	39 780 882	10,7255
5	PL0000107611	WS0428	38 280 416	10,2880
6	PL0000114393	PS0527	32 829 594	9,2564
7	PL0000113460	PS1026	33 624 153	8,8108
8	PL0000116760	PS0729	29 965 999	8,4553
9	PL0000115283	OK1025	25 120 407	6,8984
10	PL0000116596	OK0426	14 452 134	3,8571

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2024 r.
(wg stanu na 26 lipca 2024 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2024)
(on July 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	30,6990
2	PL0000115192	PS0728	45 507 599	29,9481
3	PL0000107611	WS0428	38 280 416	21,6004
4	PL0000116760	PS0729	29 965 999	17,7525

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2024 r.
(wg stanu na 26 lipca 2024 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2024)
(on July 26, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000115291	DS1033	50 288 338	29,7891
2	PL0000111498	DS1029	52 504 201	26,0976
3	PL0000112736	DS1030	47 019 530	20,5107
4	PL0000113783	DS0432	44 172 770	18,7657
5	PL0000116851	DS1034	8 893 308	4,8369

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2024 r.
(wg stanu na 26 lipca 2024 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on July 31, 2024)
(on July 26, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000111928	WZ1129	53 641 428	19,9594
2	PL0000115697	WZ1128	45 069 356	16,9469
3	PL0000114559	WZ1127	40 588 489	15,3895
4	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	11,2319
5	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	10,6834
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	9,0516
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	8,5458
8	PL0000111738	WZ0525	21 267 449	8,1913

po okresowej zmianie portfeli w dniu 31 lipca 2024 r.
 wg stanu na 26 lipca 2024 r.
 (after periodic change of index portfolio on July 31, 2024)
 (on July 26, 2024)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	17	6	8	10	4	5	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	587 817,81	180 246,58	264 747,89	344 172,35	163 925,76	182 049,49	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,18%	5,03%	5,11%	5,17%	5,32%	5,45%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,85	2,23	2,67	3,06	3,97	6,33	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,65%	2,13%	2,54%	2,91%	3,77%	6,00%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,29	2,28	2,79	3,27	4,35	7,36	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,35%	1,83%	3,00%	3,55%	5,45%	3,33%	Coupon (%)