

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

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

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115291	DS1033	50 461 412	8,3886
2	PL0000105391	WS0429	48 800 984	8,2681
3	PL0000115192	PS0728	45 507 599	8,0722
4	PL0000116760	PS0729	50 192 821	8,0293
5	PL0000111498	DS1029	54 903 201	7,9040
6	PL0000108866	DS0726	46 304 794	7,2235
7	PL0000109427	DS0727	44 403 632	6,7662
8	PL0000112736	DS1030	51 425 940	6,5871
9	PL0000113783	DS0432	50 123 010	6,3298
10	PL0000107611	WS0428	39 016 939	5,9280
11	PL0000108197	DS0725	33 157 527	5,3371
12	PL0000114393	PS0527	32 829 594	5,2308
13	PL0000113460	PS1026	33 624 153	4,9570
14	PL0000115283	OK1025	25 120 407	3,8746
15	PL0000116851	DS1034	24 391 064	3,7505
16	PL0000116596	OK0426	16 266 370	2,4477
17	PL0000117289	OK0127	6 248 441	0,9055

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

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

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	26,2379
2	PL0000109427	DS0727	44 403 632	24,5770
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	18,9999
4	PL0000113460	PS1026	33 624 153	18,0055
5	PL0000116596	OK0426	16 266 370	8,8908
6	PL0000117289	OK0127	6 248 441	3,2889

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

*GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on November 29, 2024)
(on November 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	19,4366
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	17,3931
3	PL0000109427	DS0727	44 403 632	16,2920
4	PL0000107611	WS0428	39 016 939	14,2737
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	12,5950
6	PL0000113460	PS1026	33 624 153	11,9358
7	PL0000116596	OK0426	16 266 370	5,8937
8	PL0000117289	OK0127	6 248 441	2,1802

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

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on November 29, 2024)
(on November 26, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000105391	WS0429	48 800 984	12,5785
2	PL0000115192	PS0728	45 507 599	12,2804
3	PL0000116760	PS0729	50 192 821	12,2151
4	PL0000111498	DS1029	54 903 201	12,0245
5	PL0000108866	DS0726	46 304 794	10,9893
6	PL0000109427	DS0727	44 403 632	10,2936
7	PL0000107611	WS0428	39 016 939	9,0184
8	PL0000114393	PS0527	32 829 594	7,9577
9	PL0000113460	PS1026	33 624 153	7,5413
10	PL0000116596	OK0426	16 266 370	3,7238
11	PL0000117289	OK0127	6 248 441	1,3775

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

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on November 29, 2024)
(on November 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	21,6435
2	PL0000115192	PS0728	45 507 599	21,1306
3	PL0000116760	PS0729	50 192 821	21,0181
4	PL0000111498	DS1029	54 903 201	20,6902
5	PL0000107611	WS0428	39 016 939	15,5177

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

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on November 29, 2024)
(on November 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	33,4793
2	PL0000112736	DS1030	51 425 940	26,2895
3	PL0000113783	DS0432	50 123 010	25,2626
4	PL0000116851	DS1034	24 391 064	14,9686

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

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on November 29, 2024)
(on November 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	21,5110
2	PL0000115697	WZ1128	45 069 356	17,3104
3	PL0000114559	WZ1127	40 588 489	15,7653
4	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	11,5122
5	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	10,9317
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	9,1673
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	9,0277
8	PL0000117198	WZ0330	12 500 425	4,7745

po okresowej zmianie portfeli w dniu 29 listopada 2024 r.
 wg stanu na 26 listopada 2024 rr.
 (after periodic change of index portfolio on November 29, 2024)
 (on November 26, 2024)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	17	6	8	11	5	4	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	622 567,51	171 397,60	258 558,28	409 228,15	237 830,55	155 990,41	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,13%	4,90%	4,96%	5,06%	5,18%	5,51%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,83	2,06	2,46	3,12	3,88	6,82	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,64%	1,96%	2,35%	2,97%	3,69%	6,46%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,25	2,10	2,59	3,35	4,25	7,89	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,46%	2,03%	3,19%	3,65%	4,82%	3,53%	Coupon (%)