

TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 30 kwietnia 2024 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2024 r.)

TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on April 30, 2024)
(on April 25, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	9,4151
2	PL0000115291	DS1033	49 028 338	9,3928
3	PL0000105391	WS0429	48 345 984	8,9198
4	PL0000111498	DS1029	50 939 374	8,2489
5	PL0000108866	DS0726	46 304 794	8,1578
6	PL0000108197	DS0725	38 428 531	7,0572
7	PL0000112736	DS1030	45 808 347	6,4909
8	PL0000107611	WS0428	38 280 416	6,3483
9	PL0000114393	PS0527	32 829 594	5,9567
10	PL0000113783	DS0432	42 705 386	5,8579
11	PL0000109427	DS0727	31 971 360	5,4777
12	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,4634
13	PL0000112728	PS0425	29 888 503	5,2589
14	PL0000115283	OK1025	25 120 407	4,2707
15	PL0000116760	PS0729	11 860 149	2,1616
16	PL0000116596	OK0426	9 195 096	1,5222

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 kwietnia 2024 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2024 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on April 30, 2024)
(on April 25, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	30,8178
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	26,6597
3	PL0000113460	PS1026	33 624 153	20,6389
4	PL0000115283	OK1025	25 120 407	16,1332
5	PL0000116596	OK0426	9 195 096	5,7504

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 kwietnia 2024 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2024 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on April 30, 2024)
(on April 25, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	18,4341
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	15,9469
3	PL0000107611	WS0428	38 280 416	14,3452
4	PL0000114393	PS0527	32 829 594	13,4603
5	PL0000109427	DS0727	31 971 360	12,3779
6	PL0000113460	PS1026	33 624 153	12,3455
7	PL0000115283	OK1025	25 120 407	9,6503
8	PL0000116596	OK0426	9 195 096	3,4397

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 kwietnia 2024 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2024 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on April 30, 2024)
(on April 25, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	15,0428
2	PL0000105391	WS0429	48 345 984	14,2514
3	PL0000108866	DS0726	46 304 794	13,0340
4	PL0000108197	DS0725	38 428 531	11,2754
5	PL0000107611	WS0428	38 280 416	10,1429
6	PL0000114393	PS0527	32 829 594	9,5172
7	PL0000109427	DS0727	31 971 360	8,7519
8	PL0000113460	PS1026	33 624 153	8,7290
9	PL0000115283	OK1025	25 120 407	6,8233
10	PL0000116596	OK0426	9 195 096	2,4321

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 kwietnia 2024 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2024 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on April 30, 2024)
(on April 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	26,0680
2	PL0000105391	WS0429	48 345 984	24,6964
3	PL0000107611	WS0428	38 280 416	17,5768
4	PL0000114393	PS0527	32 829 594	16,4926
5	PL0000109427	DS0727	31 971 360	15,1663

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 kwietnia 2024 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2024 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on April 30, 2024)
(on April 25, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000115291	DS1033	49 028 338	29,2135
2	PL0000111498	DS1029	50 939 374	25,6558
3	PL0000112736	DS1030	45 808 347	20,1882
4	PL0000113783	DS0432	42 705 386	18,2193
5	PL0000116760	PS0729	11 860 149	6,7231

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 30 kwietnia 2024 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2024 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on April 30, 2024)
(on April 25, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000115697	WZ1128	45 069 356	17,3488
2	PL0000114559	WZ1127	40 588 489	15,7558
3	PL0000111928	WZ1129	38 278 056	14,5962
4	PL0000111738	WZ0525	30 420 616	11,9085
5	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	11,4668
6	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	10,9400
7	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	9,2730
8	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	8,7110

po okresowej zmianie portfeli w dniu 30 kwietnia 2024 r.
wg stanu na 25 kwietnia 2024 r.
(after periodic change of index portfolio on April 30, 2024)
(on April 25, 2024)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	16	5	8	10	5	5	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	545 082,15	144 290,07	241 220,83	341 161,22	196 871,15	175 255,47	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,50%	5,28%	5,35%	5,42%	5,53%	5,71%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,92	1,86	2,43	2,91	3,67	6,36	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,71%	1,77%	2,31%	2,76%	3,48%	6,01%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,37	1,90	2,53	3,14	4,05	7,31	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,32%	1,69%	2,22%	3,52%	4,86%	3,35%	Coupon (%)