

TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2024 r.
(wg stanu na 27 maja 2024 r.)

TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on May 31, 2024)
(on May 27, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115291	DS1033	49 428 338	9,3339
2	PL0000115192	PS0728	45 507 599	9,2673
3	PL0000105391	WS0429	48 345 984	8,7761
4	PL0000111498	DS1029	52 504 201	8,3518
5	PL0000108866	DS0726	46 304 794	8,0324
6	PL0000108197	DS0725	38 428 531	6,9605
7	PL0000112736	DS1030	45 808 347	6,3883
8	PL0000107611	WS0428	38 280 416	6,2516
9	PL0000109427	DS0727	34 597 360	5,8323
10	PL0000113783	DS0432	42 705 386	5,7789
11	PL0000114393	PS0527	32 829 594	5,6424
12	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,3754
13	PL0000112728	PS0425	27 626 503	4,7921
14	PL0000115283	OK1025	25 120 407	4,2070
15	PL0000116760	PS0729	17 522 151	3,1419
16	PL0000116596	OK0426	11 457 893	1,8681

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2024 r.
(wg stanu na 27 maja 2024 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on May 31, 2024)
(on May 27, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	25,0342
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	21,6933
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	17,5854
4	PL0000113460	PS1026	33 624 153	16,7531
5	PL0000115283	OK1025	25 120 407	13,1119
6	PL0000116596	OK0426	11 457 893	5,8221

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2024 r.
(wg stanu na 27 maja 2024 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on May 31, 2024)
(on May 27, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	18,1854
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	15,7585
3	PL0000107611	WS0428	38 280 416	14,1536
4	PL0000109427	DS0727	34 597 360	13,2042
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	12,7744
6	PL0000113460	PS1026	33 624 153	12,1698
7	PL0000115283	OK1025	25 120 407	9,5248
8	PL0000116596	OK0426	11 457 893	4,2293

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2024 r.
(wg stanu na 27 maja 2024 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on May 31, 2024)
(on May 27, 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	14,8961
2	PL0000105391	WS0429	48 345 984	14,1065
3	PL0000108866	DS0726	46 304 794	12,9111
4	PL0000108197	DS0725	38 428 531	11,1881
5	PL0000107611	WS0428	38 280 416	10,0486
6	PL0000109427	DS0727	34 597 360	9,3747
7	PL0000114393	PS0527	32 829 594	9,0695
8	PL0000113460	PS1026	33 624 153	8,6403
9	PL0000115283	OK1025	25 120 407	6,7623
10	PL0000116596	OK0426	11 457 893	3,0027

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2024 r.
(wg stanu na 27 maja 2024 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on May 31, 2024)
(on May 27, 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	30,7606
2	PL0000105391	WS0429	48 345 984	29,1301
3	PL0000107611	WS0428	38 280 416	20,7505
4	PL0000109427	DS0727	34 597 360	19,3587

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2024 r.
(wg stanu na 27 maja 2024 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on May 31, 2024)
(on May 27, 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	49 428 338	28,2890
2	PL0000111498	DS1029	52 504 201	25,3123
3	PL0000112736	DS1030	45 808 347	19,3616
4	PL0000113783	DS0432	42 705 386	17,5147
5	PL0000116760	PS0729	17 522 151	9,5224

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2024 r.
(wg stanu na 27 maja 2024 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on May 31, 2024)
(on May 27, 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	16,9833
2	PL0000111928	WZ1129	43 128 797	16,0689
3	PL0000114559	WZ1127	40 588 489	15,4288
4	PL0000111738	WZ0525	30 420 616	11,6957
5	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	11,2434
6	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	10,7111
7	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	9,0749
8	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	8,7940

po okresowej zmianie portfeli w dniu 31 maja 2024 r.
 wg stanu na 27 maja 2024 r.
 (after periodic change of index portfolio on May 31, 2024)
 (on May 27, 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)	555 514,91	178 241,06	245 368,48	345 602,44	167 361,38	183 291,57	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,52%	5,33%	5,38%	5,45%	5,59%	5,73%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,85	1,97	2,36	2,82	3,73	6,20	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,64%	1,87%	2,23%	2,67%	3,53%	5,87%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,30	2,02	2,44	3,04	4,13	7,15	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,33%	2,03%	2,20%	3,49%	5,04%	3,39%	Coupon (%)