

TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 31 października 2024 r.
(wg stanu na 28 października 2024 r.)

TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on October 31, 2024)
(on October 28, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115291	DS1033	50 461 412	8,5268
2	PL0000105391	WS0429	48 800 984	8,4479
3	PL0000115192	PS0728	45 507 599	8,2608
4	PL0000116760	PS0729	50 192 821	8,1881
5	PL0000111498	DS1029	52 504 201	7,7172
6	PL0000108866	DS0726	46 304 794	7,4493
7	PL0000109427	DS0727	42 482 132	6,6576
8	PL0000112736	DS1030	50 773 940	6,6268
9	PL0000113783	DS0432	49 118 010	6,3223
10	PL0000107611	WS0428	38 280 416	5,9602
11	PL0000108197	DS0725	33 157 527	5,5326
12	PL0000114393	PS0527	32 829 594	5,3766
13	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,1087
14	PL0000115283	OK1025	25 120 407	4,0139
15	PL0000116851	DS1034	21 008 064	3,2818
16	PL0000116596	OK0426	16 266 370	2,5293

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 października 2024 r.
(wg stanu na 28 października 2024 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on October 31, 2024)
(on October 28, 2024)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	27,4665
2	PL0000109427	DS0727	42 482 132	24,5472
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	19,8240
4	PL0000113460	PS1026	33 624 153	18,8365
5	PL0000116596	OK0426	16 266 370	9,3259

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 października 2024 r.
(wg stanu na 28 października 2024 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on October 31, 2024)
(on October 28, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	19,9814
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	18,0185
3	PL0000109427	DS0727	42 482 132	16,1034
4	PL0000107611	WS0428	38 280 416	14,4166
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	13,0049
6	PL0000113460	PS1026	33 624 153	12,3571
7	PL0000116596	OK0426	16 266 370	6,1180

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 października 2024 r.
(wg stanu na 28 października 2024 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on October 31, 2024)
(on October 28, 2024)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000105391	WS0429	48 800 984	12,8591
2	PL0000115192	PS0728	45 507 599	12,5744
3	PL0000116760	PS0729	50 192 821	12,4638
4	PL0000111498	DS1029	52 504 201	11,7468
5	PL0000108866	DS0726	46 304 794	11,3391
6	PL0000109427	DS0727	42 482 132	10,1339
7	PL0000107611	WS0428	38 280 416	9,0724
8	PL0000114393	PS0527	32 829 594	8,1840
9	PL0000113460	PS1026	33 624 153	7,7764
10	PL0000116596	OK0426	16 266 370	3,8501

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 października 2024 r.
(wg stanu na 28 października 2024 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on October 31, 2024)
(on October 28, 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	21,9003
2	PL0000115192	PS0728	45 507 599	21,4154
3	PL0000116760	PS0729	50 192 821	21,2270
4	PL0000111498	DS1029	52 504 201	20,0060
5	PL0000107611	WS0428	38 280 416	15,4512

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 października 2024 r.
(wg stanu na 28 października 2024 r.)

*GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on October 31, 2024)
(on October 28, 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	34,4410
2	PL0000112736	DS1030	50 773 940	26,7665
3	PL0000113783	DS0432	49 118 010	25,5368
4	PL0000116851	DS1034	21 008 064	13,2557

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 31 października 2024 r.
(wg stanu na 28 października 2024 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on October 31, 2024)
(on October 28, 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	22,6197
2	PL0000115697	WZ1128	45 069 356	18,2389
3	PL0000114559	WZ1127	40 588 489	16,5984
4	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	12,1274
5	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	11,5100
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	9,6734
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	9,2321

po okresowej zmianie portfeli w dniu 31 października 2024 r.
wg stanu na 28 października 2024 r.
(after periodic change of index portfolio on October 31, 2024)
(on October 28, 2024)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	16	5	7	10	5	4	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	602 211,04	163 328,50	248 968,91	395 626,46	232 297,96	149 094,21	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,17%	4,87%	5,00%	5,17%	5,37%	5,69%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,89	2,13	2,55	3,20	3,96	6,87	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,69%	2,03%	2,42%	3,04%	3,76%	6,50%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,31	2,18	2,68	3,44	4,33	7,94	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,49%	2,09%	3,27%	3,71%	4,85%	3,51%	Coupon (%)