

**TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2023 r.
(wg stanu na 26 maja 2023 r.)**

*TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on May 31, 2023)
(on May 26, 2023)*

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	9,3931
2	PL0000111498	DS1029	47 343 374	8,8188
3	PL0000108197	DS0725	38 428 531	8,2351
4	PL0000111720	PS1024	36 779 096	7,8030
5	PL0000107611	WS0428	37 283 411	7,0956
6	PL0000114393	PS0527	32 829 594	6,6476
7	PL0000111191	PS0424	30 628 616	6,5597
8	PL0000109427	DS0727	31 971 360	6,2737
9	PL0000115192	PS0728	25 068 931	6,1896
10	PL0000113460	PS1026	33 624 153	6,1201
11	PL0000112728	PS0425	29 888 503	5,9769
12	PL0000112736	DS1030	36 734 745	5,8829
13	PL0000113783	DS0432	36 104 267	5,6306
14	PL0000114021	OK0724	18 381 331	3,7847
15	PL0000115291	DS1033	9 147 180	2,0610
16	PL0000105391	WS0429	8 680 338	1,8932
17	PL0000115283	OK1025	8 544 228	1,6344

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2023 r.
(wg stanu na 26 maja 2023 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on May 31, 2023)
(on May 26, 2023)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108197	DS0725	38 428 531	30,0178
2	PL0000111720	PS1024	36 779 096	28,4428
3	PL0000112728	PS0425	29 888 503	21,7862
4	PL0000114021	OK0724	18 381 331	13,7955
5	PL0000115283	OK1025	8 544 228	5,9576

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2023 r.
(wg stanu na 26 maja 2023 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on May 31, 2023)
(on May 26, 2023)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	18,9396
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	16,6047
3	PL0000111720	PS1024	36 779 096	15,7335
4	PL0000114393	PS0527	32 829 594	13,4038
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	12,3403
6	PL0000112728	PS0425	29 888 503	12,0513
7	PL0000114021	OK0724	18 381 331	7,6312
8	PL0000115283	OK1025	8 544 228	3,2955

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2023 r.
(wg stanu na 26 maja 2023 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on May 31, 2023)
(on May 26, 2023)

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	PL0000108866	DS0726	46 304 794	14,9181
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	13,0790
3	PL0000111720	PS1024	36 779 096	12,3928
4	PL0000107611	WS0428	37 283 411	11,2693
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	10,5577
6	PL0000109427	DS0727	31 971 360	9,9639
7	PL0000113460	PS1026	33 624 153	9,7200
8	PL0000112728	PS0425	29 888 503	9,4925
9	PL0000114021	OK0724	18 381 331	6,0108
10	PL0000115283	OK1025	8 544 228	2,5958

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2023 r.
(wg stanu na 26 maja 2023 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on May 31, 2023)
(on May 26, 2023)

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	PL0000108866	DS0726	46 304 794	26,4369
2	PL0000107611	WS0428	37 283 411	19,9707
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	18,7097
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	17,6574
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	17,2252

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2023 r.
(wg stanu na 26 maja 2023 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on May 31, 2023)
(on May 26, 2023)

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	PL0000111498	DS1029	47 343 374	28,9369
2	PL0000115192	PS0728	25 068 931	20,3097
3	PL0000112736	DS1030	36 734 745	19,3032
4	PL0000113783	DS0432	36 104 267	18,4756
5	PL0000115291	DS1033	9 147 180	6,7625
6	PL0000105391	WS0429	8 680 338	6,2120

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 31 maja 2023 r.
(wg stanu na 26 maja 2023 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on May 31, 2023)
(on May 26, 2023)

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	PL0000114559	WZ1127	37 197 527	14,9515
2	PL0000111738	WZ0525	30 420 616	12,5146
3	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	11,9495
4	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	11,3339
5	PL0000110615	WZ0524	25 599 587	10,5796
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	9,5533
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	9,4377
8	PL0000107454	WZ0124	19 817 597	8,4121
9	PL0000111928	WZ1129	14 360 706	5,6802
10	PL0000115697	WZ1128	14 073 689	5,5876

wg stanu na 26 maja 2023 r.
(on May 26, 2023)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	17	5	8	10	5	6	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	454 239,49	124 616,38	225 279,58	286 008,39	161 392,01	138 434,36	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	6,04%	5,99%	6,02%	6,04%	6,08%	6,08%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,75	1,73	2,45	2,84	3,70	6,24	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,54%	1,63%	2,31%	2,68%	3,49%	5,88%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,07	1,77	2,53	2,96	3,89	7,05	Maturity (in years)
Kupon (%)	2,61%	1,78%	1,99%	2,13%	2,40%	3,65%	Coupon (%)