

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

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

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	8,7190
2	PL0000111498	DS1029	47 343 374	8,5795
3	PL0000115192	PS0728	37 921 598	8,4567
4	PL0000108197	DS0725	38 428 531	7,5233
5	PL0000111720	PS1024	36 779 096	7,3257
6	PL0000107611	WS0428	37 283 411	6,8648
7	PL0000114393	PS0527	32 829 594	6,3819
8	PL0000111191	PS0424	30 146 717	6,0381
9	PL0000112736	DS1030	38 311 265	6,0228
10	PL0000109427	DS0727	31 971 360	5,8840
11	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,8561
12	PL0000112728	PS0425	29 888 503	5,6375
13	PL0000113783	DS0432	36 104 267	5,5500
14	PL0000115291	DS1033	16 341 387	3,6242
15	PL0000114021	OK0724	18 381 331	3,5464
16	PL0000115283	OK1025	11 879 043	2,1525
17	PL0000105391	WS0429	8 680 338	1,8377

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

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

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	27,8048
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	23,9916
3	PL0000111720	PS1024	36 779 096	23,3615
4	PL0000112728	PS0425	29 888 503	17,9780
5	PL0000115283	OK1025	11 879 043	6,8642

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

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

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	17,6213
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	15,2047
3	PL0000111720	PS1024	36 779 096	14,8053
4	PL0000114393	PS0527	32 829 594	12,8980
5	PL0000109427	DS0727	31 971 360	11,8917
6	PL0000113460	PS1026	33 624 153	11,8353
7	PL0000112728	PS0425	29 888 503	11,3935
8	PL0000115283	OK1025	11 879 043	4,3502

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

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

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	13,4549
2	PL0000115192	PS0728	37 921 598	13,0502
3	PL0000108197	DS0725	38 428 531	11,6097
4	PL0000111720	PS1024	36 779 096	11,3048
5	PL0000107611	WS0428	37 283 411	10,5937
6	PL0000114393	PS0527	32 829 594	9,8484
7	PL0000109427	DS0727	31 971 360	9,0801
8	PL0000113460	PS1026	33 624 153	9,0370
9	PL0000112728	PS0425	29 888 503	8,6997
10	PL0000115283	OK1025	11 879 043	3,3216

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

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2023)
(on July 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	PL0000115192	PS0728	37 921 598	25,2865
2	PL0000107611	WS0428	37 283 411	20,5267
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	19,0826
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	17,5939
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	17,5104

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

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

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000111498	DS1029	47 343 374	33,4949
2	PL0000112736	DS1030	38 311 265	23,5136
3	PL0000113783	DS0432	36 104 267	21,6676
4	PL0000115291	DS1033	16 341 387	14,1492
5	PL0000105391	WS0429	8 680 338	7,1747

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

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

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000114559	WZ1127	37 197 527	15,9740
2	PL0000111738	WZ0525	30 420 616	13,3518
3	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	12,7879
4	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	12,1039
5	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	10,1950
6	PL0000110615	WZ0524	22 755 729	10,0514
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	9,7372
8	PL0000115697	WZ1128	22 989 700	9,7343
9	PL0000111928	WZ1129	14 360 706	6,0644

wg stanu na 26 lipca 2023 r.
(on July 26, 2023)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	17	5	8	10	5	5	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	490 426,20	153 787,04	242 661,91	317 802,54	164 015,50	125 619,03	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,41%	5,46%	5,40%	5,38%	5,31%	5,34%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,76	2,04	2,60	3,03	3,96	6,69	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,57%	1,93%	2,47%	2,88%	3,76%	6,35%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,09	2,08	2,67	3,19	4,24	7,56	Maturity (in years)
Kupon (%)	2,78%	2,14%	2,16%	2,92%	3,66%	2,86%	Coupon (%)