

**TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 30 listopada 2023 r.
(wg stanu na 27 listopada 2023 r.)**

*TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on November 30, 2023)
(on November 27, 2023)*

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	9,8813
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	8,5133
3	PL0000111498	DS1029	47 343 374	8,0879
4	PL0000108197	DS0725	38 428 531	7,3555
5	PL0000111720	PS1024	35 407 716	6,7640
6	PL0000107611	WS0428	37 283 411	6,6876
7	PL0000114393	PS0527	32 829 594	6,2283
8	PL0000112736	DS1030	39 775 265	5,9805
9	PL0000109427	DS0727	31 971 360	5,7317
10	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,7024
11	PL0000105391	WS0429	27 699 719	5,6799
12	PL0000115291	DS1033	27 415 553	5,5512
13	PL0000112728	PS0425	29 888 503	5,5176
14	PL0000113783	DS0432	36 104 267	5,3658
15	PL0000115283	OK1025	22 590 597	4,0042
16	PL0000114021	OK0724	15 574 647	2,9488

**GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 listopada 2023 r.
(wg stanu na 27 listopada 2023 r.)**

*GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on November 30, 2023)
(on November 27, 2023)*

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	27,3800
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	23,6564
3	PL0000113460	PS1026	33 624 153	18,3399
4	PL0000112728	PS0425	29 888 503	17,7455
5	PL0000115283	OK1025	22 590 597	12,8781

**GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 listopada 2023 r.
(wg stanu na 27 listopada 2023 r.)**

*GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on November 30, 2023)
(on November 27, 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	19,7740
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	17,0847
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	14,4665
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	13,3131
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	13,2452
6	PL0000112728	PS0425	29 888 503	12,8159
7	PL0000115283	OK1025	22 590 597	9,3006

**GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 listopada 2023 r.
(wg stanu na 27 listopada 2023 r.)**

*GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on November 30, 2023)
(on November 27, 2023)*

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
<i>No</i>	<i>ISIN code</i>	<i>Name</i>	<i>Number of bonds</i>	<i>Share (%)</i>
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	16,5733
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	14,2788
3	PL0000108197	DS0725	38 428 531	12,3369
4	PL0000107611	WS0428	37 283 411	11,2168
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	10,4463
6	PL0000109427	DS0727	31 971 360	9,6134
7	PL0000113460	PS1026	33 624 153	9,5643
8	PL0000112728	PS0425	29 888 503	9,2543
9	PL0000115283	OK1025	22 590 597	6,7160

**GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 listopada 2023 r.
(wg stanu na 27 listopada 2023 r.)**

*GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on November 30, 2023)
(on November 27, 2023)*

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	34,6362
2	PL0000107611	WS0428	37 283 411	23,4416
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	21,8314
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	20,0908

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 30 listopada 2023 r.
(wg stanu na 27 listopada 2023 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on November 30, 2023)
(on November 27, 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	26,3747
2	PL0000112736	DS1030	39 775 265	19,5024
3	PL0000105391	WS0429	27 699 719	18,5223
4	PL0000115291	DS1033	27 415 553	18,1026
5	PL0000113783	DS0432	36 104 267	17,4980

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 30 listopada 2023 r.
(wg stanu na 27 listopada 2023 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on November 30, 2023)
(on November 27, 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	16,6797
2	PL0000115697	WZ1128	36 126 466	15,9537
3	PL0000111738	WZ0525	30 420 616	13,9284
4	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	13,3832
5	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	12,6209
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	10,6038
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	10,5164
8	PL0000111928	WZ1129	14 360 706	6,3139

wg stanu na 27 listopada 2023 r.
(on November 27, 2023)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	16	5	7	9	4	5	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	510 745,20	158 806,00	219 890,82	304 516,03	145 710,03	156 621,73	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,40%	5,38%	5,38%	5,38%	5,38%	5,47%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,77	2,12	2,47	2,92	3,79	6,35	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,57%	2,01%	2,34%	2,77%	3,59%	6,02%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,13	2,15	2,55	3,11	4,15	7,17	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,01%	1,63%	2,05%	3,03%	4,56%	3,43%	Coupon (%)