

**TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2026 r.
(wg stanu na 28 lipca 2026 r.)**

*TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on July 31, 2026)
(on July 28, 2026)*

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	PL0000115291	DS1033	66 836 632	7,6644
2	PL0000117990	PS0730	69 481 869	7,2657
3	PL0000118188	DS1035	65 315 097	6,8893
4	PL0000105391	WS0429	57 196 120	6,3362
5	PL0000116851	DS1034	59 375 538	6,3276
6	PL0000116760	PS0729	57 073 247	6,0736
7	PL0000117370	PS0130	55 439 705	6,0668
8	PL0000111498	DS1029	58 755 701	6,0037
9	PL0000118519	PS0131	55 493 049	5,8950
10	PL0000113783	DS0432	63 684 961	5,6377
11	PL0000118998	PS0731	55 918 677	5,6313
12	PL0000112736	DS1030	58 098 574	5,3653
13	PL0000115192	PS0728	45 507 599	5,1066
14	PL0000109427	DS0727	44 403 632	4,6414
15	PL0000118089	OK0128	45 149 768	4,4998
16	PL0000107611	WS0428	40 376 939	4,2029
17	PL0000114393	PS0527	25 405 545	2,7099
18	PL0000119087	DS0436	22 195 119	2,3118
19	PL0000119178	OK0129	14 453 766	1,3708

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2026 r.
(wg stanu na 28 lipca 2026 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2026)
(on July 28, 2026)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000105391	WS0429	57 196 120	22,9656
2	PL0000116760	PS0729	57 073 247	22,0138
3	PL0000115192	PS0728	45 507 599	18,5089
4	PL0000118089	OK0128	45 149 768	16,3097
5	PL0000107611	WS0428	40 376 939	15,2335
6	PL0000119178	OK0129	14 453 766	4,9686

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2026 r.
(wg stanu na 28 lipca 2026 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2026)
(on July 28, 2026)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000117990	PS0730	69 481 869	15,4832
2	PL0000105391	WS0429	57 196 120	13,5025
3	PL0000116760	PS0729	57 073 247	12,9429
4	PL0000117370	PS0130	55 439 705	12,9284
5	PL0000111498	DS1029	58 755 701	12,7939
6	PL0000115192	PS0728	45 507 599	10,8822
7	PL0000118089	OK0128	45 149 768	9,5892
8	PL0000107611	WS0428	40 376 939	8,9564
9	PL0000119178	OK0129	14 453 766	2,9212

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2026 r.
(wg stanu na 28 lipca 2026 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2026)
(on July 28, 2026)

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	PL0000117990	PS0730	69 481 869	11,3851
2	PL0000105391	WS0429	57 196 120	9,9286
3	PL0000116760	PS0729	57 073 247	9,5171
4	PL0000117370	PS0130	55 439 705	9,5065
5	PL0000111498	DS1029	58 755 701	9,4076
6	PL0000118519	PS0131	55 493 049	9,2372
7	PL0000118998	PS0731	55 918 677	8,8241
8	PL0000112736	DS1030	58 098 574	8,4072
9	PL0000115192	PS0728	45 507 599	8,0018
10	PL0000118089	OK0128	45 149 768	7,0511
11	PL0000107611	WS0428	40 376 939	6,5858
12	PL0000119178	OK0129	14 453 766	2,1480

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2026 r.
(wg stanu na 28 lipca 2026 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2026)
(on July 28, 2026)

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	PL0000117990	PS0730	69 481 869	20,0556
2	PL0000117370	PS0130	55 439 705	16,7463
3	PL0000111498	DS1029	58 755 701	16,5721
4	PL0000118519	PS0131	55 493 049	16,2720
5	PL0000118998	PS0731	55 918 677	15,5442
6	PL0000112736	DS1030	58 098 574	14,8098

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2026 r.
(wg stanu na 28 lipca 2026 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2026)
(on July 28, 2026)

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	66 836 632	26,5842
2	PL0000118188	DS1035	65 315 097	23,8958
3	PL0000116851	DS1034	59 375 538	21,9474
4	PL0000113783	DS0432	63 684 961	19,5543
5	PL0000119087	DS0436	22 195 119	8,0183

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2026 r.
(wg stanu na 28 lipca 2026 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on July 31, 2026)
(on July 28, 2026)

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	PL0000117198	WZ0330	56 465 355	16,6274
2	PL0000111928	WZ1129	56 493 128	16,5818
3	PL0000115697	WZ1128	45 069 356	13,3413
4	PL0000118170	WZ0930	43 780 510	12,8272
5	PL0000114559	WZ1127	40 588 489	12,1143
6	PL0000118774	NZ0331	39 951 268	11,3442
7	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	8,4108
8	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	7,0624
9	PL0000118600	NZ0928	5 715 144	1,6907

po okresowej zmianie portfeli w dniu 31 lipca 2026 r.
wg stanu na 28 lipca 2026 r.
(after periodic change of index portfolio on July 31, 2026)
(on on July 28, 2026)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	19	6	9	12	6	5	Number of constituents
Wartość portfela (mln PLN)	944 364,02	260 550,18	443 154,87	602 673,05	342 122,87	272 267,30	Portfolio value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	4,83%	4,40%	4,55%	4,67%	4,88%	5,44%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,91	2,20	2,68	3,10	3,78	6,45	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,72%	2,11%	2,57%	2,96%	3,61%	6,12%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,43	2,29	2,83	3,29	4,06	7,84	Maturity (in years)
Kupon (%)	4,06%	4,17%	4,15%	3,92%	3,73%	4,65%	Coupon (%)