

**TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 28 kwietnia 2023 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2023 r.)**

*TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on April 28, 2023)
(on April 25, 2023)*

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	9,4585
2	PL0000111498	DS1029	47 343 374	8,9307
3	PL0000108197	DS0725	38 428 531	8,2694
4	PL0000111720	PS1024	36 779 096	7,8336
5	PL0000107611	WS0428	37 283 411	7,1700
6	PL0000114393	PS0527	32 829 594	6,9761
7	PL0000111191	PS0424	32 053 130	6,8847
8	PL0000109427	DS0727	31 971 360	6,3348
9	PL0000113460	PS1026	33 624 153	6,1667
10	PL0000112728	PS0425	29 888 503	6,0023
11	PL0000112736	DS1030	36 734 745	5,9992
12	PL0000113783	DS0432	36 104 267	5,7771
13	PL0000115192	PS0728	21 422 585	5,3423
14	PL0000114021	OK0724	18 381 331	3,7973
15	PL0000105391	WS0429	8 680 338	1,9192
16	PL0000115291	DS1033	7 079 126	1,6284
17	PL0000115283	OK1025	7 852 270	1,5097

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 28 kwietnia 2023 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2023 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on April 28, 2023)
(on April 25, 2023)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108197	DS0725	38 428 531	30,1666
2	PL0000111720	PS1024	36 779 096	28,5771
3	PL0000112728	PS0425	29 888 503	21,8965
4	PL0000114021	OK0724	18 381 331	13,8525
5	PL0000115283	OK1025	7 852 270	5,5074

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 28 kwietnia 2023 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2023 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on April 28, 2023)
(on April 25, 2023)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	21,9773
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	19,2143
3	PL0000111720	PS1024	36 779 096	18,2019
4	PL0000113460	PS1026	33 624 153	14,3287
5	PL0000112728	PS0425	29 888 503	13,9468
6	PL0000114021	OK0724	18 381 331	8,8232
7	PL0000115283	OK1025	7 852 270	3,5079

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 28 kwietnia 2023 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2023 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on April 28, 2023)
(on April 25, 2023)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	14,8909
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	13,0188
3	PL0000111720	PS1024	36 779 096	12,3329
4	PL0000107611	WS0428	37 283 411	11,2881
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	10,9828
6	PL0000109427	DS0727	31 971 360	9,9732
7	PL0000113460	PS1026	33 624 153	9,7085
8	PL0000112728	PS0425	29 888 503	9,4498
9	PL0000114021	OK0724	18 381 331	5,9782
10	PL0000115283	OK1025	7 852 270	2,3768

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 28 kwietnia 2023 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2023 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on April 28, 2023)
(on April 25, 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	26,1963
2	PL0000107611	WS0428	37 283 411	19,8582
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	19,3212
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	17,5449
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	17,0794

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 28 kwietnia 2023 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2023 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on April 28, 2023)
(on April 25, 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	30,1744
2	PL0000112736	DS1030	36 734 745	20,2698
3	PL0000113783	DS0432	36 104 267	19,5192
4	PL0000115192	PS0728	21 422 585	18,0503
5	PL0000105391	WS0429	8 680 338	6,4844
6	PL0000115291	DS1033	7 079 126	5,5018

GPWB-BWZ - portfel indeksu od dnia 2 maja 2023 r.
(wg stanu na 25 kwietnia 2023 r.)

GPWB-BWZ - index portfolio starting from May 2, 2023)
(on April 25, 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	15,2542
2	PL0000111738	WZ0525	30 420 616	12,8013
3	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	12,2505
4	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	11,5433
5	PL0000110615	WZ0524	25 599 587	10,8262
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	9,7018
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	9,3005
8	PL0000107454	WZ0124	20 695 056	8,6479
9	PL0000111928	WZ1129	14 360 706	5,8017
10	PL0000115697	WZ1128	9 558 285	3,8726

wg stanu na 25 kwietnia 2023 r.
(on April 25, 2023)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	17	5	7	10	5	6	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	450 712,80	123 550,78	193 975,35	286 285,41	162 734,63	133 397,07	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,89%	5,91%	5,91%	5,91%	5,92%	5,85%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,82	1,82	2,34	2,92	3,76	6,39	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,60%	1,72%	2,21%	2,76%	3,55%	6,03%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,13	1,86	2,40	3,06	3,98	7,15	Maturity (in years)
Kupon (%)	2,56%	1,79%	1,72%	2,14%	2,41%	3,48%	Coupon (%)