

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

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

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	9,1712
2	PL0000111498	DS1029	47 343 374	8,7451
3	PL0000108197	DS0725	38 428 531	7,9892
4	PL0000111720	PS1024	36 779 096	7,5437
5	PL0000107611	WS0428	37 283 411	6,9931
6	PL0000115192	PS0728	28 267 131	6,8879
7	PL0000114393	PS0527	32 829 594	6,5072
8	PL0000111191	PS0424	30 628 616	6,3304
9	PL0000109427	DS0727	31 971 360	6,1591
10	PL0000112736	DS1030	38 311 265	6,1197
11	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,9784
12	PL0000112728	PS0425	29 888 503	5,7952
13	PL0000113783	DS0432	36 104 267	5,6119
14	PL0000114021	OK0724	18 381 331	3,6556
15	PL0000115291	DS1033	12 496 380	2,8014
16	PL0000105391	WS0429	8 680 338	1,8748
17	PL0000115283	OK1025	9 890 528	1,8362

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

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

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108197	DS0725	38 428 531	29,7882
2	PL0000111720	PS1024	36 779 096	28,1274
3	PL0000112728	PS0425	29 888 503	21,6077
4	PL0000114021	OK0724	18 381 331	13,6302
5	PL0000115283	OK1025	9 890 528	6,8465

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

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on June 30, 2023)
(on June 27, 2023)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	18,9189
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	16,4804
3	PL0000111720	PS1024	36 779 096	15,5616
4	PL0000114393	PS0527	32 829 594	13,4233
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	12,3325
6	PL0000112728	PS0425	29 888 503	11,9545
7	PL0000114021	OK0724	18 381 331	7,5409
8	PL0000115283	OK1025	9 890 528	3,7878

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

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

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	14,8814
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	12,9633
3	PL0000111720	PS1024	36 779 096	12,2406
4	PL0000107611	WS0428	37 283 411	11,3471
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	10,5586
6	PL0000109427	DS0727	31 971 360	9,9939
7	PL0000113460	PS1026	33 624 153	9,7006
8	PL0000112728	PS0425	29 888 503	9,4033
9	PL0000114021	OK0724	18 381 331	5,9316
10	PL0000115283	OK1025	9 890 528	2,9795

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

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on June 30, 2023)
(on June 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	26,3473
2	PL0000107611	WS0428	37 283 411	20,0899
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	18,6939
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	17,6941
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	17,1747

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

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on June 30, 2023)
(on June 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	27,2937
2	PL0000115192	PS0728	28 267 131	21,4972
3	PL0000112736	DS1030	38 311 265	19,0996
4	PL0000113783	DS0432	36 104 267	17,5149
5	PL0000115291	DS1033	12 496 380	8,7433
6	PL0000105391	WS0429	8 680 338	5,8513

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

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on June 30, 2023)
(on June 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	16,1494
2	PL0000111738	WZ0525	30 420 616	13,5079
3	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	12,9111
4	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	12,2415
5	PL0000110615	WZ0524	25 599 587	11,4298
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	10,2970
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	10,1965
8	PL0000115697	WZ1128	16 697 289	7,1516
9	PL0000111928	WZ1129	14 360 706	6,1151

wg stanu na 27 czerwca 2023 r.

(on June 27, 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)	472 437,01	126 706,86	229 021,42	291 157,46	164 450,61	151 372,54	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,72%	5,85%	5,78%	5,75%	5,68%	5,61%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,74	1,66	2,38	2,77	3,62	6,17	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,54%	1,57%	2,25%	2,62%	3,42%	5,85%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,08	1,70	2,46	2,89	3,81	7,01	Maturity (in years)
Kupon (%)	2,67%	1,76%	1,98%	2,12%	2,40%	3,77%	Coupon (%)