

**TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 31 sierpnia 2023 r.
(wg stanu na 28 sierpnia 2023 r.)**

*TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on August 31, 2023)
(on August 28, 2023)*

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	43 976 699	9,6003
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	8,5873
3	PL0000111498	DS1029	47 343 374	8,3659
4	PL0000108197	DS0725	38 428 531	7,4239
5	PL0000111720	PS1024	36 779 096	7,2368
6	PL0000107611	WS0428	37 283 411	6,7228
7	PL0000114393	PS0527	32 829 594	6,2670
8	PL0000112736	DS1030	39 775 265	6,0684
9	PL0000111191	PS0424	29 658 625	5,8796
10	PL0000109427	DS0727	31 971 360	5,7665
11	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,7641
12	PL0000112728	PS0425	29 888 503	5,5679
13	PL0000113783	DS0432	36 104 267	5,3667
14	PL0000115291	DS1033	18 358 190	3,9334
15	PL0000114021	OK0724	17 701 831	3,3793
16	PL0000115283	OK1025	12 756 949	2,2801
17	PL0000105391	WS0429	8 680 338	1,7899

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 sierpnia 2023 r.
(wg stanu na 28 sierpnia 2023 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on August 31, 2023)
(on August 28, 2023)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	27,6155
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	23,8741
3	PL0000111720	PS1024	36 779 096	23,2725
4	PL0000112728	PS0425	29 888 503	17,9056
5	PL0000115283	OK1025	12 756 949	7,3324

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 sierpnia 2023 r.
(wg stanu na 28 sierpnia 2023 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on August 31, 2023)
(on August 28, 2023)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	17,5632
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	15,1838
3	PL0000111720	PS1024	36 779 096	14,8011
4	PL0000114393	PS0527	32 829 594	12,8177
5	PL0000109427	DS0727	31 971 360	11,7939
6	PL0000113460	PS1026	33 624 153	11,7891
7	PL0000112728	PS0425	29 888 503	11,3878
8	PL0000115283	OK1025	12 756 949	4,6633

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 sierpnia 2023 r.
(wg stanu na 28 sierpnia 2023 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on August 31, 2023)
(on August 28, 2023)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	43 976 699	14,7207
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	13,1673
3	PL0000108197	DS0725	38 428 531	11,3834
4	PL0000111720	PS1024	36 779 096	11,0965
5	PL0000107611	WS0428	37 283 411	10,3084
6	PL0000114393	PS0527	32 829 594	9,6096
7	PL0000109427	DS0727	31 971 360	8,8420
8	PL0000113460	PS1026	33 624 153	8,8384
9	PL0000112728	PS0425	29 888 503	8,5376
10	PL0000115283	OK1025	12 756 949	3,4961

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 sierpnia 2023 r.
(wg stanu na 28 sierpnia 2023 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on August 31, 2023)
(on August 28, 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	43 976 699	28,1364
2	PL0000107611	WS0428	37 283 411	19,7029
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	18,3672
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	16,9002
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	16,8933

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 sierpnia 2023 r.
(wg stanu na 28 sierpnia 2023 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on August 31, 2023)
(on August 28, 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	32,7761
2	PL0000112736	DS1030	39 775 265	23,7748
3	PL0000113783	DS0432	36 104 267	21,0260
4	PL0000115291	DS1033	18 358 190	15,4105
5	PL0000105391	WS0429	8 680 338	7,0126

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 31 sierpnia 2023 r.
(wg stanu na 28 sierpnia 2023 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on August 31, 2023)
(on August 28, 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	15,8901
2	PL0000111738	WZ0525	30 420 616	13,3023
3	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	12,7217
4	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	12,0178
5	PL0000115697	WZ1128	26 104 242	11,0180
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	10,0839
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	9,6836
8	PL0000110615	WZ0524	21 037 041	9,2650
9	PL0000111928	WZ1129	14 360 706	6,0176

wg stanu na 28 sierpnia 2023 r.
(on August 28, 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)	500 162,79	155 530,51	244 547,58	326 189,65	170 659,14	127 663,19	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	5,42%	5,36%	5,37%	5,39%	5,43%	5,57%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,69	1,95	2,50	2,96	3,88	6,61	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,50%	1,85%	2,38%	2,81%	3,68%	6,26%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,03	1,99	2,58	3,13	4,18	7,50	Maturity (in years)
Kupon (%)	2,84%	2,12%	2,16%	3,00%	3,81%	2,89%	Coupon (%)