

**TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 29 grudnia 2023 r.
(wg stanu na 22 grudnia 2023 r.)**

*TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on December 29, 2023)
(on December 22, 2023)*

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	9,8836
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	8,4482
3	PL0000111498	DS1029	47 343 374	8,1737
4	PL0000108197	DS0725	38 428 531	7,2548
5	PL0000105391	WS0429	34 174 838	7,0286
6	PL0000107611	WS0428	38 280 416	6,8669
7	PL0000115291	DS1033	33 041 882	6,8085
8	PL0000111720	PS1024	35 407 716	6,6435
9	PL0000114393	PS0527	32 829 594	6,2043
10	PL0000112736	DS1030	39 775 265	6,0680
11	PL0000109427	DS0727	31 971 360	5,7229
12	PL0000113460	PS1026	33 624 153	5,6639
13	PL0000113783	DS0432	36 104 267	5,4684
14	PL0000112728	PS0425	29 888 503	5,4363
15	PL0000115283	OK1025	24 745 407	4,3283

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 29 grudnia 2023 r.
(wg stanu na 22 grudnia 2023 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on December 29, 2023)
(on December 22, 2023)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	27,1370
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	23,3037
3	PL0000113460	PS1026	33 624 153	18,1936
4	PL0000112728	PS0425	29 888 503	17,4624
5	PL0000115283	OK1025	24 745 407	13,9033

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 29 grudnia 2023 r.
(wg stanu na 22 grudnia 2023 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on December 29, 2023)
(on December 22, 2023)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000108866	DS0726	46 304 794	19,6201
2	PL0000108197	DS0725	38 428 531	16,8486
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	14,4090
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	13,2909
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	13,1540
6	PL0000112728	PS0425	29 888 503	12,6254
7	PL0000115283	OK1025	24 745 407	10,0521

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 29 grudnia 2023 r.
(wg stanu na 22 grudnia 2023 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on December 29, 2023)
(on December 22, 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	45 507 599	16,5252
2	PL0000108866	DS0726	46 304 794	14,1252
3	PL0000108197	DS0725	38 428 531	12,1299
4	PL0000107611	WS0428	38 280 416	11,4814
5	PL0000114393	PS0527	32 829 594	10,3735
6	PL0000109427	DS0727	31 971 360	9,5686
7	PL0000113460	PS1026	33 624 153	9,4700
8	PL0000112728	PS0425	29 888 503	9,0894
9	PL0000115283	OK1025	24 745 407	7,2369

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 29 grudnia 2023 r.
(wg stanu na 22 grudnia 2023 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on December 29, 2023)
(on December 22, 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	45 507 599	34,4643
2	PL0000107611	WS0428	38 280 416	23,9452
3	PL0000114393	PS0527	32 829 594	21,6346
4	PL0000109427	DS0727	31 971 360	19,9559

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 29 grudnia 2023 r.
(wg stanu na 22 grudnia 2023 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on December 29, 2023)
(on December 22, 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	24,3648
2	PL0000105391	WS0429	34 174 838	20,9514
3	PL0000115291	DS1033	33 041 882	20,2953
4	PL0000112736	DS1030	39 775 265	18,0878
5	PL0000113783	DS0432	36 104 267	16,3007

**GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 29 grudnia 2023 r.
(wg stanu na 22 grudnia 2023 r.)**

*GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on December 29, 2023)
(on December 22, 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	PL0000115697	WZ1128	44 319 356	18,9419
2	PL0000114559	WZ1127	37 197 527	16,1037
3	PL0000111738	WZ0525	30 420 616	13,4068
4	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	12,8832
5	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	12,1813
6	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	10,2676
7	PL0000108817	WZ0126	22 483 160	10,1216
8	PL0000111928	WZ1129	14 360 706	6,0940

wg stanu na 22 grudnia 2023 r.
(on December 22, 2023)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	15	5	7	9	4	5	Number of constituents
Wartość nominalna (mln PLN)	522 908,72	162 789,30	225 157,67	312 747,54	149 958,24	175 421,61	National value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	4,92%	4,94%	4,91%	4,90%	4,86%	4,94%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,87	2,05	2,40	2,85	3,72	6,28	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,69%	1,95%	2,29%	2,72%	3,55%	5,98%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,27	2,08	2,47	3,04	4,08	7,14	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,17%	1,61%	2,04%	3,02%	4,55%	3,60%	Coupon (%)