

**TBSP.Index po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2025 r.
(wg stanu na 29 lipca 2025 r.)**

*TBSP.Index (after periodic change of index portfolio on July 31, 2025)
(on July 29, 2025)*

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	60 080 227	8,4857
2	PL0000105391	WS0429	57 196 120	7,7733
3	PL0000116760	PS0729	57 073 247	7,3804
4	PL0000111498	DS1029	58 755 701	7,1820
5	PL0000117370	PS0130	52 166 387	6,9561
6	PL0000116851	DS1034	53 205 192	6,9499
7	PL0000115192	PS0728	45 507 599	6,3587
8	PL0000113783	DS0432	56 995 470	6,0252
9	PL0000108866	DS0726	46 304 794	5,8702
10	PL0000117990	PS0730	45 810 797	5,8167
11	PL0000112736	DS1030	52 645 930	5,7471
12	PL0000109427	DS0727	44 403 632	5,5295
13	PL0000107611	WS0428	39 016 939	4,8589
14	PL0000114393	PS0527	32 829 594	4,2231
15	PL0000113460	PS1026	33 624 153	4,1355
16	PL0000117289	OK0127	19 284 162	2,3337
17	PL0000116596	OK0426	15 215 370	1,9024
18	PL0000118188	DS1035	10 152 181	1,3143
19	PL0000118089	OK0128	9 999 091	1,1575

GPWB-B1Y3Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2025 r.
(wg stanu na 29 lipca 2025 r.)

GPWB-B1Y3Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2025)
(on July 29, 2025)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000115192	PS0728	45 507 599	22,2356
2	PL0000109427	DS0727	44 403 632	19,3360
3	PL0000107611	WS0428	39 016 939	16,9910
4	PL0000114393	PS0527	32 829 594	14,7678
5	PL0000113460	PS1026	33 624 153	14,4613
6	PL0000117289	OK0127	19 284 162	8,1607
7	PL0000118089	OK0128	9 999 091	4,0476

GPWB-B1Y4Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2025 r.
(wg stanu na 29 lipca 2025 r.)

GPWB-B1Y4Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2025)
(on July 29, 2025)

Lp. No	Kod ISIN code	Nazwa Name	Liczba obligacji Number of bonds	Udział (%) Share (%)
1	PL0000105391	WS0429	57 196 120	17,7673
2	PL0000116760	PS0729	57 073 247	16,8692
3	PL0000115192	PS0728	45 507 599	14,5340
4	PL0000109427	DS0727	44 403 632	12,6387
5	PL0000107611	WS0428	39 016 939	11,1059
6	PL0000114393	PS0527	32 829 594	9,6528
7	PL0000113460	PS1026	33 624 153	9,4524
8	PL0000117289	OK0127	19 284 162	5,3341
9	PL0000118089	OK0128	9 999 091	2,6457

GPWB-B1Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2025 r.
(wg stanu na 29 lipca 2025 r.)

GPWB-B1Y5Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2025)
(on July 29, 2025)

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	PL0000105391	WS0429	57 196 120	12,2020
2	PL0000116760	PS0729	57 073 247	11,5852
3	PL0000111498	DS1029	58 755 701	11,2737
4	PL0000117370	PS0130	52 166 387	10,9191
5	PL0000115192	PS0728	45 507 599	9,9814
6	PL0000117990	PS0730	45 810 797	9,1306
7	PL0000109427	DS0727	44 403 632	8,6798
8	PL0000107611	WS0428	39 016 939	7,6271
9	PL0000114393	PS0527	32 829 594	6,6292
10	PL0000113460	PS1026	33 624 153	6,4916
11	PL0000117289	OK0127	19 284 162	3,6633
12	PL0000118089	OK0128	9 999 091	1,8170

GPWB-B3Y5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2025 r.
(wg stanu na 29 lipca 2025 r.)

GPWB-B3Y5Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2025)
(on July 29, 2025)

Lp.	Kod	Nazwa	Liczba obligacji	Udział (%)
No	ISIN code	Name	Number of bonds	Share (%)
1	PL0000105391	WS0429	57 196 120	22,1409
2	PL0000116760	PS0729	57 073 247	21,0217
3	PL0000111498	DS1029	58 755 701	20,4566
4	PL0000117370	PS0130	52 166 387	19,8131
5	PL0000117990	PS0730	45 810 797	16,5678

GPWB-B5Y po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2025 r.
(wg stanu na 29 lipca 2025 r.)

GPWB-B5Y (after periodic change of index portfolio on July 31, 2025)
(on July 29, 2025)

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	60 080 227	29,7513
2	PL0000116851	DS1034	53 205 192	24,3667
3	PL0000113783	DS0432	56 995 470	21,1246
4	PL0000112736	DS1030	52 645 930	20,1496
5	PL0000118188	DS1035	10 152 181	4,6079

GPWB-BWZ po okresowej zmianie portfela w dniu 31 lipca 2025 r.
(wg stanu na 29 lipca 2025 r.)

GPWB-BWZ (after periodic change of index portfolio on July 31, 2025)
(on July 29, 2025)

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	19,1844
2	PL0000111928	WZ1129	56 493 128	19,0847
3	PL0000115697	WZ1128	45 069 356	15,3828
4	PL0000114559	WZ1127	40 588 489	13,9539
5	PL0000113130	WZ1126	29 449 203	10,2056
6	PL0000110383	WZ0528	28 262 564	9,6971
7	PL0000113213	WZ1131	24 393 202	8,0818
8	PL0000118170	WZ0930	13 048 113	4,4097

po okresowej zmianie portfeli w dniu 31 lipca 2025 r.
 wg stanu na 29 lipca 2025 r.
 (after periodic change of index portfolio on July 31, 2025)
 (on July 29, 2025)

Indeks	TBSP.INDEX	GPWB-B1Y3Y	GPWB-B1Y4Y	GPWB-B1Y5Y	GPWB-B3Y5Y	GPWB-B5Y	Index
Liczba uczestników	19	7	9	12	5	5	Number of constituents
Wartość portfela (mln PLN)	777 007,71	222 200,13	339 945,29	494 994,78	272 794,65	221 618,97	Portfolio value (PLN mln)
Dochód w terminie do wykupu YTM (%)	4,63%	4,27%	4,38%	4,48%	4,66%	5,12%	YTM (%)
Czas trwania Macaulaya (w latach)	3,89	2,12	2,62	3,11	3,91	6,44	Macaulay duration (in years)
Zmodyfikowany czas trwania (%)	3,71%	2,03%	2,51%	2,97%	3,74%	6,12%	Modified duration (%)
Termin do wykupu (w latach)	4,37	2,19	2,77	3,32	4,25	7,65	Maturity (in years)
Kupon (%)	3,77%	3,21%	3,92%	3,96%	4,57%	3,86%	Coupon (%)