



Broj: 12-171/21
Datum: 21.05.2021. godine

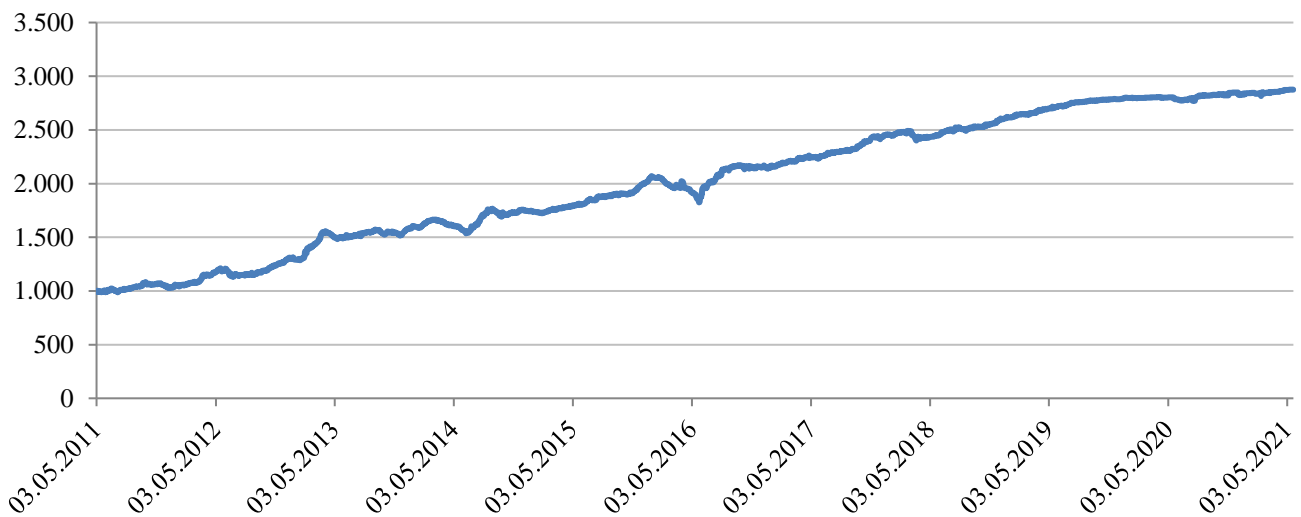
DVADESETA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)

I Analiza vrijednosti ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 21.05.2021. godine izvršila dvadesetu redovnu reviziju ORS-a.

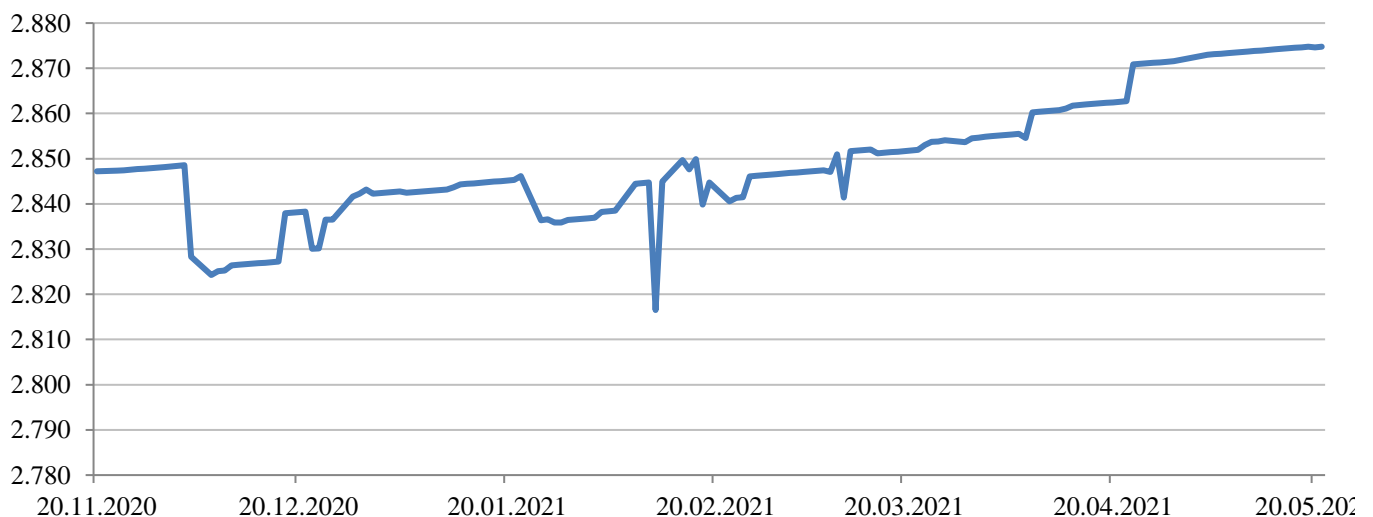
Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 21.05.2021. godine imala rast od 187,48% i na dan 21.05.2021. godine vrijednost ORS-a iznosi 2.874,77 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)



U periodu između devetnaeste redovne i dvadesete redovne revizije ORS-a (od 20.11.2020. do 21.05.2021. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 0,97%.

ORS (od 20.11.2020. do 21.05.2021. godine)



Promjena cijene i učešća hov koje ulaze u sastav ORS-a

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 20.11.2020.	Učešće u ORS-u na dan 20.11.2020.	Cijena na dan 21.05.2021.	Učešće u ORS-u na dan 21.05.2021.	Promjena cijene
RSDS-O-H	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 8	100,75	5,79%	101	5,80%	0,25%
RSRS-O-A	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 1	99,5	4,87%	99,5	4,86%	0,00%
RSRS-O-D	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 4	99	2,09%	99,2	2,09%	0,20%
RSRS-O-F	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	99	27,57%	98,99	27,51%	-0,01%
RSRS-O-G	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	99	2,19%	98,68	2,18%	-0,32%
RSRS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	98	2,41%	98	2,41%	0,00%
RSRS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	97,51	2,72%	98	2,73%	0,50%
RSRS-O-K	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	97,5	5,28%	97,8	5,29%	0,31%
RSRS-O-L	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	96,6	9,11%	97,5	9,17%	0,93%
RSRS-O-M	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	95,8	37,96%	96	37,96%	0,21%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (0,97%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (0,20%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (0,76%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 21.05.2021.godine

Redni broj	Oznaka HOV	Nominalna vrijednost	Nominalna kamatna stopa	Datum delistiranja	Procenat trgovanih dana	Promet u posmatranih šest mjeseci (Ponder)	Zatvarajuća cijena na dan 21.05.2021.	Učešće u indeksu
1.	RSRS-O-M	15.125.492	1,50%	11.11.2032	30,95%	1.430.753,56	96	64,39%
2.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	28,57%	348.373,93	97,5	15,92%
3.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	14,29%	180.148,23	98	8,28%
4.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	11,11%	151.577,72	98	6,96%
5.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	12,70%	96.959,00	97,8	4,45%
6.	RSBD-O19	144.134.000	3,00%	14.04.2025	0,79%	9.620.000,00	96,2	
7.	RSBD-O18	35.000.000	3,00%	04.04.2025	0,79%	9.326.590,00	96,2	
8.	RSRS-O-N	5.825.691	1,50%	18.10.2033	61,90%	4.887.534,65	96	
9.	RSBD-O10	36.000.000	2,20%	04.03.2024	0,79%	4.158.000,00	103,95	
10.	RSBD-O05	35.000.000	3,78%	04.09.2024	0,79%	2.367.160,00	102,92	
11.	RSDS-O-H	45.304.600	2,50%	29.09.2023	3,97%	479.518,62	101	
12.	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	22.12.2025	3,97%	298.229,70	98,68	
13.	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	13.12.2023	3,17%	211.044,63	99,6	
14.	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	29.05.2025	9,52%	196.236,55	98,99	
15.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	8,73%	177.909,12	98,5	
16.	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	28.06.2023	4,76%	172.462,86	99,50	
17.	RSDS-O-G	33.870.590	2,50%	19.08.2021	0,79%	54.280,80	100,52	
18.	RSRS-O-D	35.996.199	1,50%	13.06.2024	5,56%	39.040,31	99,20	
19.	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	05.06.2025	3,97%	33.166,84	99,00	
20.	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	26.10.2023	3,97%	14.213,08	99,50	

III Revizija sastava ORS-a

U narednoj tabeli je pregled hartija na osnovu ispunjenosti uslova u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a.

Redni broj	Status HOV u ORS-u	Naziv	Oznaka HOV	Cijena	Ponder
1.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	RSRS-O-M	96	1.430.753,56
2.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	97,5	348.373,93
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	RSRS-O-J	98	180.148,23
4.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	RSRS-O-I	98	151.577,72
5.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	RSRS-O-K	97,8	96.959,00
6.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 8	RSDS-O-H		
7.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 1	RSRS-O-A		
8.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 4	RSRS-O-D		
9.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	RSRS-O-F		
10.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	RSRS-O-G		

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,004100%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

- 1) Milan Božić
- 2) Slaviša Risović
- 3) Milan Grahovac