

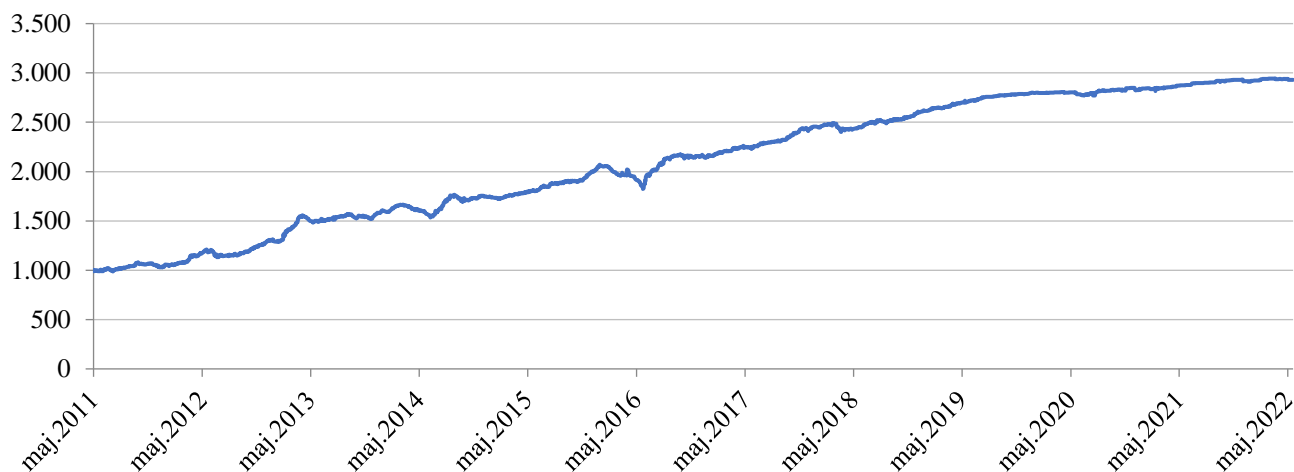
Broj: 12-164/22

Datum: 20.05.2022. godine

**DVADESET DRUGA REDOVNA REVIZIJA
INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)****I Analiza vrijednosti ORS-a**

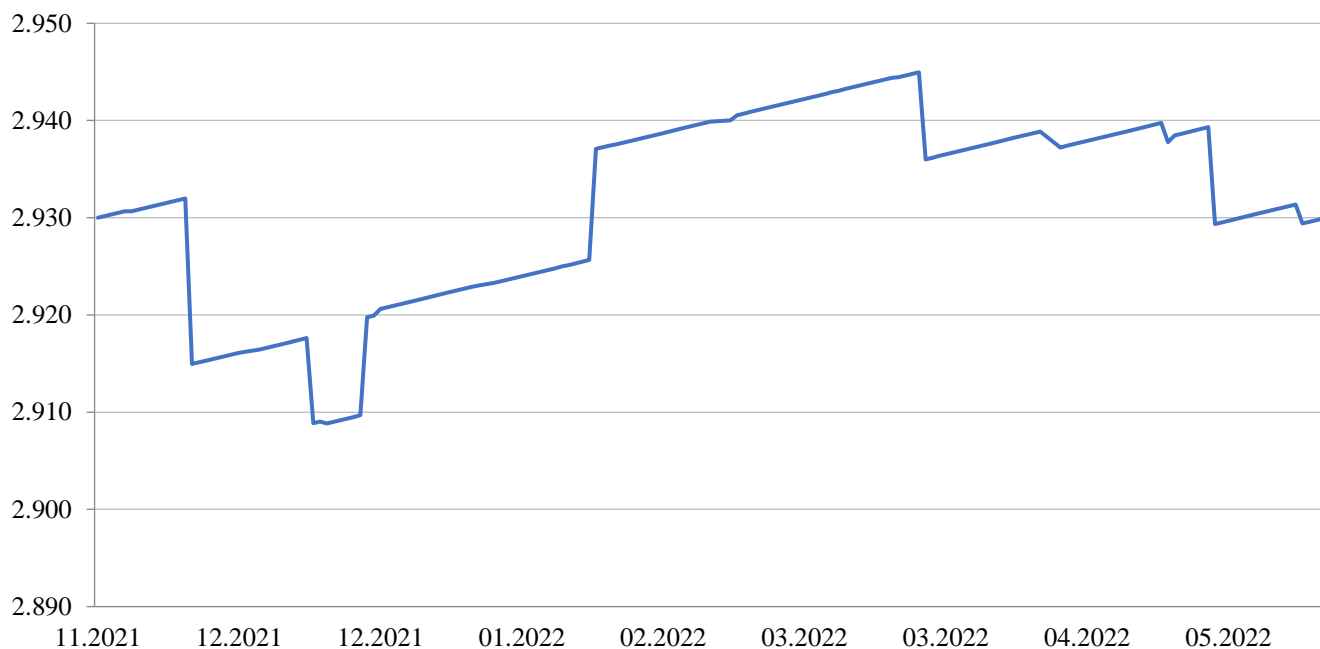
Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 20.05.2022. godine izvršila dvadeset drugu redovnu reviziju ORS-a.

Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 20.05.2022. godine imala rast od 192,99% i na dan 20.05.2022. godine vrijednost ORS-a iznosi 2.929,91 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)

U periodu između dvadeset jedane redovne i dvadeset dvae redovne revizije ORS-a (od 19.11.2021. do 20.05.2022. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila pad vrijednost od 0,003%.

ORS (od 19.11.2021. do 20.05.2022. godine)



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 19.11.2021.	Učešće u ORS-u na dan 19.11.2021.	Cijena na dan 20.05.2022.	Učešće u ORS-u na dan 20.05.2022.	Promjena cijene
RSDS-O-H	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 8	101	3,66%	99	3,63%	-1,98%
RSDS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 9	101,2	55,68%	101,2	56,26%	0,00%
RSRS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	98,11	4,50%	98,17	4,55%	0,06%
RSRS-O-L	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	98	2,44%	95	2,39%	-3,06%
RSRS-O-M	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	97,6	33,72%	95	33,17%	-2,66%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (0,00%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (-1,04%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (1,04%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 20.05.2022.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 20.05.2022.	Učešće u indeksu
1.	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	29.05.2025	12,80%	3.142.806,65	98,5	60,88%
2.	RSDS-O-I	10.290.916	2,50%	27.07.2026	40,00%	1.613.606,89	101,2	32,11%
3.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	20,00%	242.454,96	95	4,53%
4.	RSRS-O-M	15.125.492	1,50%	11.11.2032	12,80%	132.867,05	95	2,48%
5.	RSBD-O20	25.000.000	3,10%	06.06.2025	4,80%	16.803.781,20	100,28	
6.	RSBD-O08	100.000.000	2,89%	27.01.2023	2,40%	12.438.889,88	100,07	
7.	RSBD-O09	35.000.000	2,45%	02.02.2024	0,80%	9.186.300,00	102,07	
8.	RSRS-O-P	8.150.169	1,50%	02.11.2034	56,14%	7.287.573,15	93,5	
9.	RSBD-O19	144.134.000	3,00%	14.04.2025	1,60%	5.557.929,90	97,14	
10.	RSBD-O23	30.000.000	2,96%	02.12.2030	0,80%	5.207.500,00	104,15	
11.	RSBD-O21	25.000.000	2,80%	08.07.2025	0,80%	4.898.564,00	101,21	
12.	RSDS-O-H	45.304.600	2,50%	29.09.2023	2,40%	1.730.317,96	99	
13.	RSBD-O13	35.000.000	2,00%	17.06.2024	0,80%	1.441.337,10	103,47	
14.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	6,40%	1.307.833,28	98,3	
15.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	6,40%	1.258.543,78	98,17	
16.	RSBD-O25	20.000.000	1,99%	22.03.2028	2,40%	1.145.100,00	104,10	
17.	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	26.10.2023	8,00%	839.481,03	99,30	
18.	RSBD-O17	35.000.000	1,71%	04.02.2027	1,60%	799.333,00	103,70	
19.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	6,40%	716.905,53	98,18	
20.	RSRS-O-D	35.996.199	1,50%	13.06.2024	6,40%	534.854,15	99,2	
21.	RSBD-O10	36.000.000	2,20%	04.03.2024	0,80%	512.650,00	102,53	
22.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	9,60%	467.035,80	96	
23.	RSRS-O-N	5.825.691	1,50%	18.10.2033	12,00%	356.230,01	95	
24.	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	22.12.2025	4,80%	252.134,17	98,4	
25.	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	13.12.2023	0,80%	131.736,00	99	
26.	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	05.06.2025	8,00%	51.717,60	99	
27.	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	28.06.2023	2,40%	10.546,02	99,6	

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.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	RSRS-O-F	98,5	3.142.806,65
2.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 9	RSDS-O-I	101,2	1.613.606,89
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	95	242.454,96
4.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	RSRS-O-M	95	132.867,05
5.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	RSRS-O-J		
6.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 8	RSDS-O-H		
7.					

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,004900%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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