

Broj: 12-436/21
Datum: 19.11.2021. godine

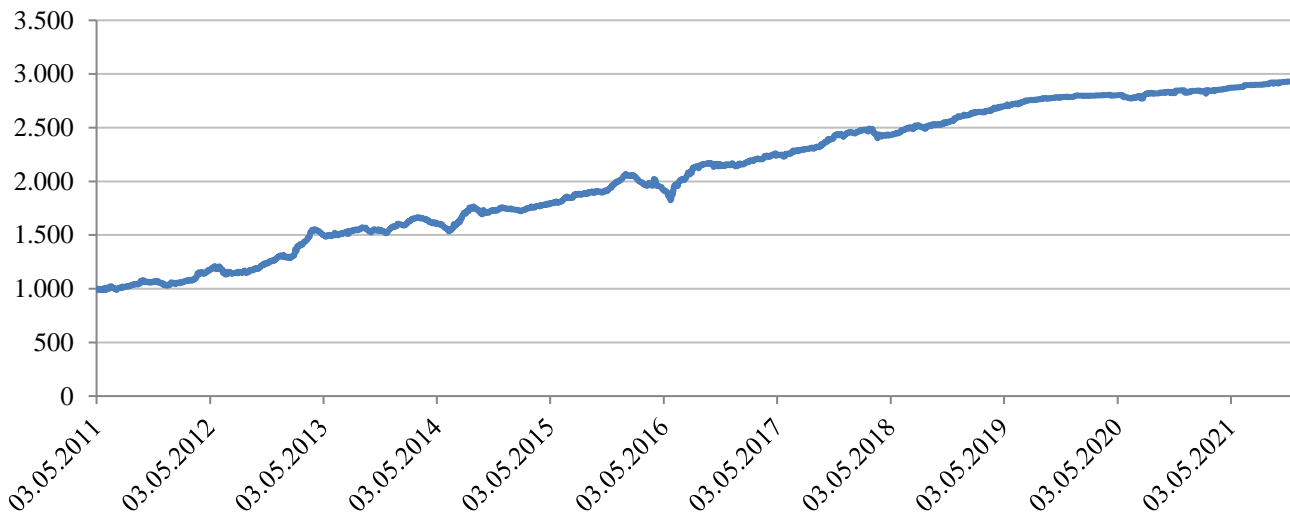
DVADESET PRVA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)

I Analiza vrijednosti ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 19.11.2021. godine izvršila dvadeset jedanu redovnu reviziju ORS-a.

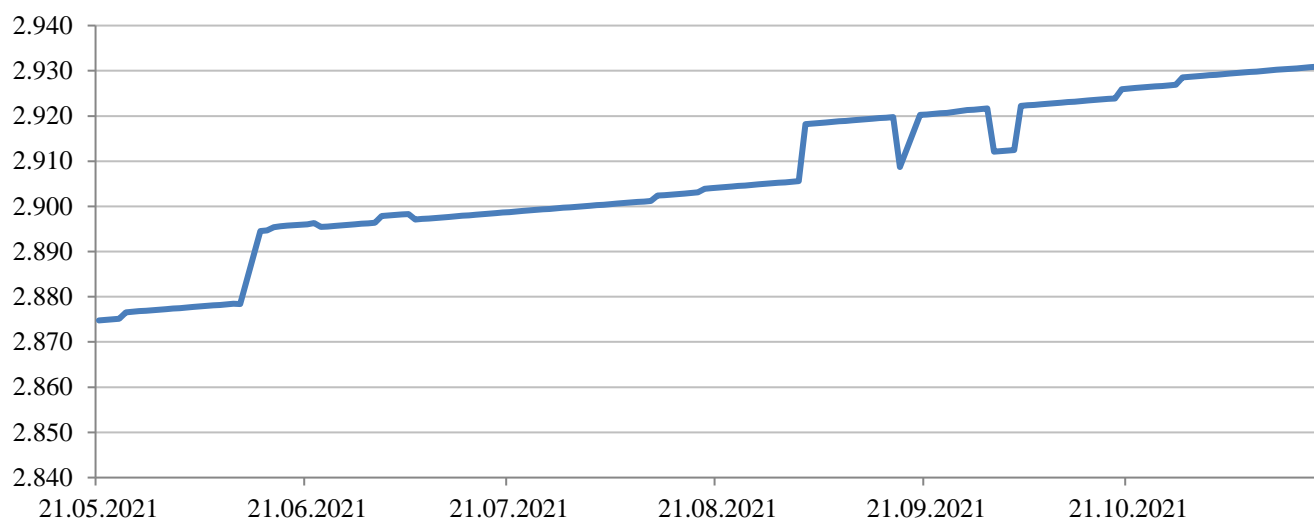
Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 19.11.2021. godine imala rast od 193,00% i na dan 19.11.2021. godine vrijednost ORS-a iznosi 2.930,00 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)



U periodu između dvadesete redovne i dvadeset jedane redovne revizije ORS-a (od 21.05.2021. do 19.11.2021. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 1,92%.

ORS (od 21.05.2021. do 19.11.2021. godine)



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 21.05.2021.	Učešće u ORS-u na dan 21.05.2021.	Cijena na dan 19.11.2021.	Učešće u ORS-u na dan 19.11.2021.	Promjena cijene
RSRS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	98	6,96%	98	6,88%	0,00%
RSRS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	98	8,28%	98,11	8,19%	0,11%
RSRS-O-K	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	97,8	4,45%	98	4,40%	0,20%
RSRS-O-L	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	97,5	15,92%	98	15,82%	0,51%
RSRS-O-M	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	96	64,39%	97,6	64,70%	1,67%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (1,92%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (1,17%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (0,75%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 19.11.2021.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 19.11.2021.	Učešće u indeksu
1.	RSDS-O-I	10.290.916	2,50%	27.07.2026	76,67%	3.570.848,40	101,2	55,68%
2.	RSRS-O-M	15.125.492	1,50%	11.11.2032	34,11%	2.242.190,51	97,6	33,72%
3.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	10,08%	297.793,50	98,11	4,50%
4.	RSDS-O-H	45.304.600	2,50%	29.09.2023	10,85%	235.238,28	101	3,66%
5.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	19,38%	161.751,55	98	2,44%
6.	RSBD-O-N	20.000.000	4,50%	01.03.2023	5,43%	14.667.397,80	103,33	
7.	RSBD-O02	50.000.000	3,49%	03.05.2022	0,78%	5.085.500,00	101,71	
8.	RSBD-O-T	40.000.000	4,50%	05.09.2023	0,78%	4.246.837,50	105,25	
9.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	8,53%	1.952.344,70	99	
10.	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	26.10.2023	9,30%	1.638.563,29	99,8	
11.	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	28.06.2023	1,55%	1.189.050,30	99,5	
12.	RSBD-O08	100.000.000	2,89%	27.01.2023	0,78%	1.012.800,00	101,28	
13.	RSBD-O20	25.000.000	3,10%	06.06.2025	0,78%	989.520,00	104,16	
14.	RSRS-O-N	5.825.691	1,50%	18.10.2033	20,93%	795.084,42	97	

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-stara devizna štednja 9	RSDS-O-I	101,2	3.570.848,40
2.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	RSRS-O-M	97,6	2.242.190,51
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	RSRS-O-J	98,11	297.793,50
4.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 8	RSDS-O-H	101	235.238,28
5.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	98	161.751,55
6.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	RSRS-O-I		
7.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	RSRS-O-K		

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,005700%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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