

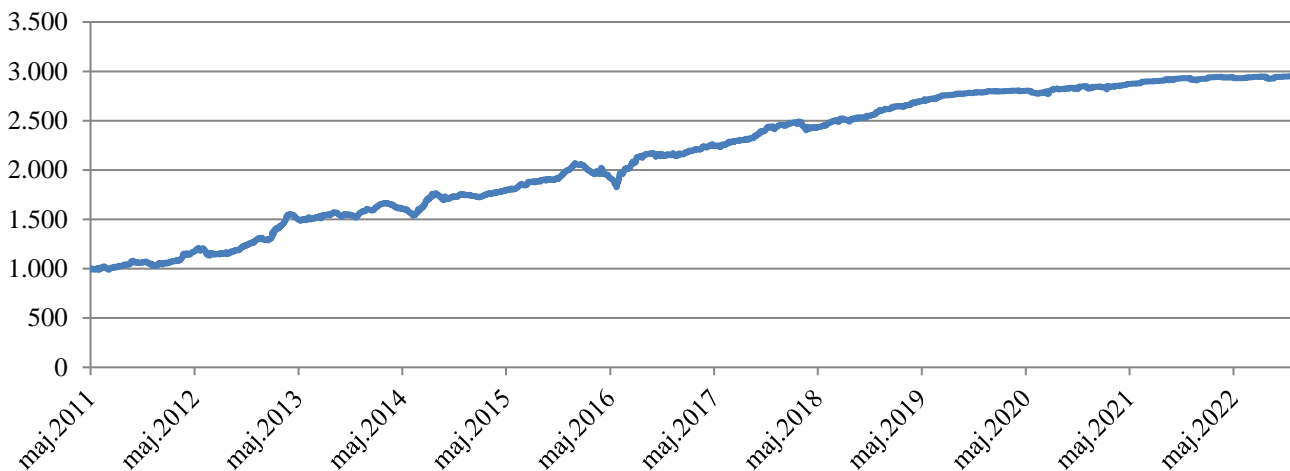
Broj: 12-445/22

Datum: 18.11.2022. godine

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

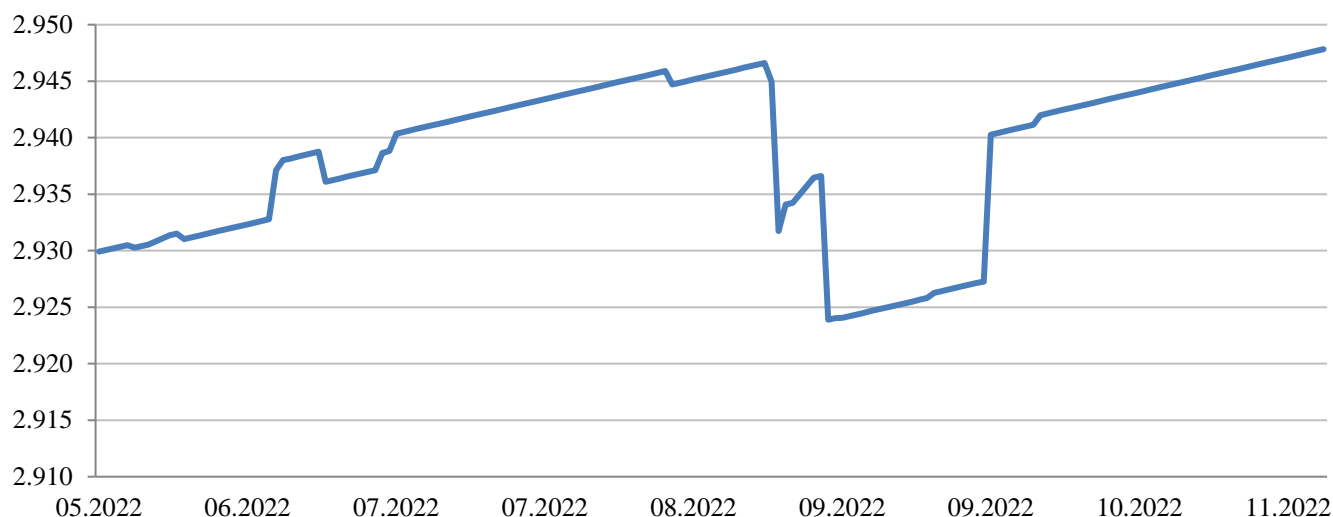
Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 18.11.2022. godine izvršila dvadeset treću redovnu reviziju ORS-a.

Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 18.11.2022. godine imala rast od 194,91% i na dan 18.11.2022. godine vrijednost ORS-a iznosi 2.949,14 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)

U periodu između dvadeset druge redovne i dvadeset treće redovne revizije ORS-a (od 20.05.2022. do 18.11.2022. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 0,66%.

ORS (od 20.05.2022. do 18.11.2022. godine)



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 20.05.2022.	Učešće u ORS-u na dan 20.05.2022.	Cijena na dan 18.11.2022.	Učešće u ORS-u na dan 18.11.2022.	Promjena cijene
RSDS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 9	101,2	32,11%	100	31,81%	-1,19%
RSRS-O-F	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	98,5	60,88%	98,5	61,03%	0,00%
RSRS-O-L	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	95	4,53%	96,68	4,62%	1,77%
RSRS-O-M	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	95	2,48%	97	2,54%	2,11%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (0,66%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (-0,25%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (0,91%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 18.11.2022.godine

Redni broj	Oznaka HOV	Nominalna vrijednost	Nominalna kamatna stopa	Datum delistiranja	Procenat trgovanih dana	Promet u posmatраниh šest mjeseci (Ponder)	Zatvarajuća cijena na dan 18.11.2022.	Učešće u indeksu
1.	RSDS-O-I	10.290.916	2,50%	27.07.2026	10,08%	405.107,98	100	40,56%
2.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	10,85%	401.316,74	96,68	38,84%
3.	RSRS-O-M	15.125.492	1,50%	11.11.2032	13,18%	212.147,03	97	20,60%
4.	RSBD-O09	35.000.000	2,45%	02.02.2024	4,65%	2.118.913,50	101,59	
5.	RSDS-O-J	5.666.849	2,50%	27.07.2027	59,32%	1.499.266,51	96,78	
6.	RSRS-O-P	8.150.169	1,50%	02.11.2034	21,71%	657.824,48	94,5	
7.	RSRS-O-R	3.299.834	1,50%	30.08.2035	85,71%	430.627,03	88,35	
8.	RSRS-O-D	35.996.199	1,50%	13.06.2024	5,43%	267.901,51	99,2	
9.	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	05.06.2025	3,88%	190.723,44	98,5	
10.	RSDS-O-H	45.304.600	2,50%	29.09.2023	5,43%	139.042,86	100	
11.	RSRS-O-N	5.825.691	1,50%	18.10.2033	8,53%	136.169,35	96,98	

12.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	3,88%	121.388,65	98
13.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	6,98%	118.553,73	96,7
14.	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	22.12.2025	2,33%	65.258,88	98,4
15.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	8,53%	62.063,85	99
16.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	2,33%	42.431,42	98,00
17.	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	29.05.2025	3,88%	39.419,10	98,50
18.	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	26.10.2023	1,55%	4.175,40	99,30
19.	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	13.12.2023	0,78%	2.126,92	99
20.	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	28.06.2023	0,78%	1.641,41	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.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 9	RSDS-O-I	100	405.107,98
2.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	96,68	401.316,74
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	RSRS-O-M	97	212.147,03
4.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	RSRS-O-F		

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,005100%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

- 1) Milan Božić
- 2) Slaviša Risović
- 3) Nebojša Vuković