



Broj: 12-181/20

Datum: 22.05.2020. godine

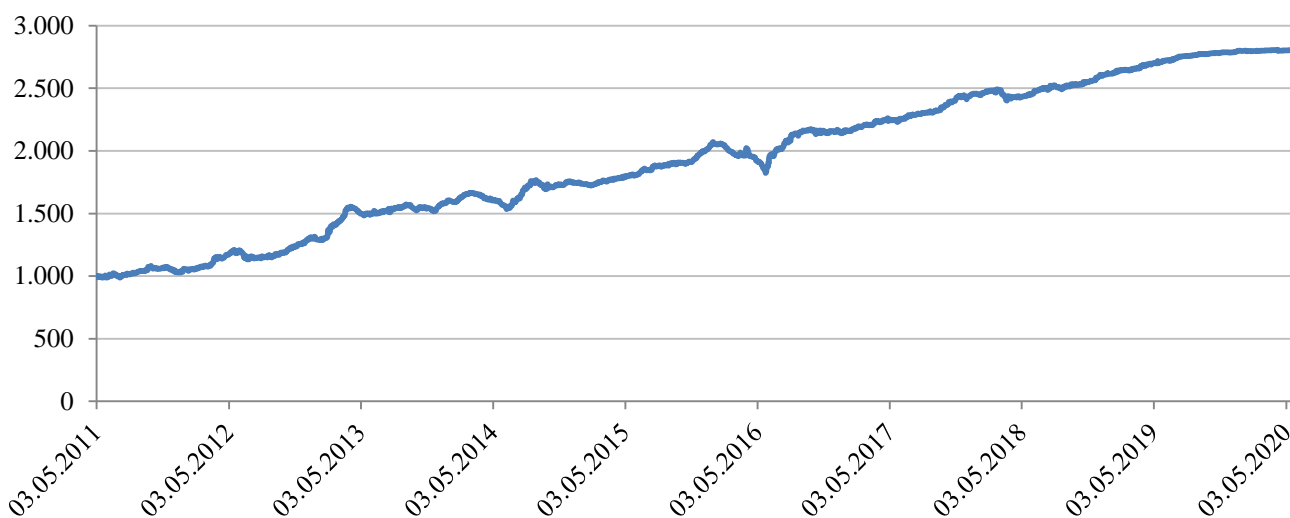
OSAMNAESTA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)

I Analiza vrijednosti ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 22.05.2020. godine izvršila osamnaestu redovnu reviziju ORS-a.

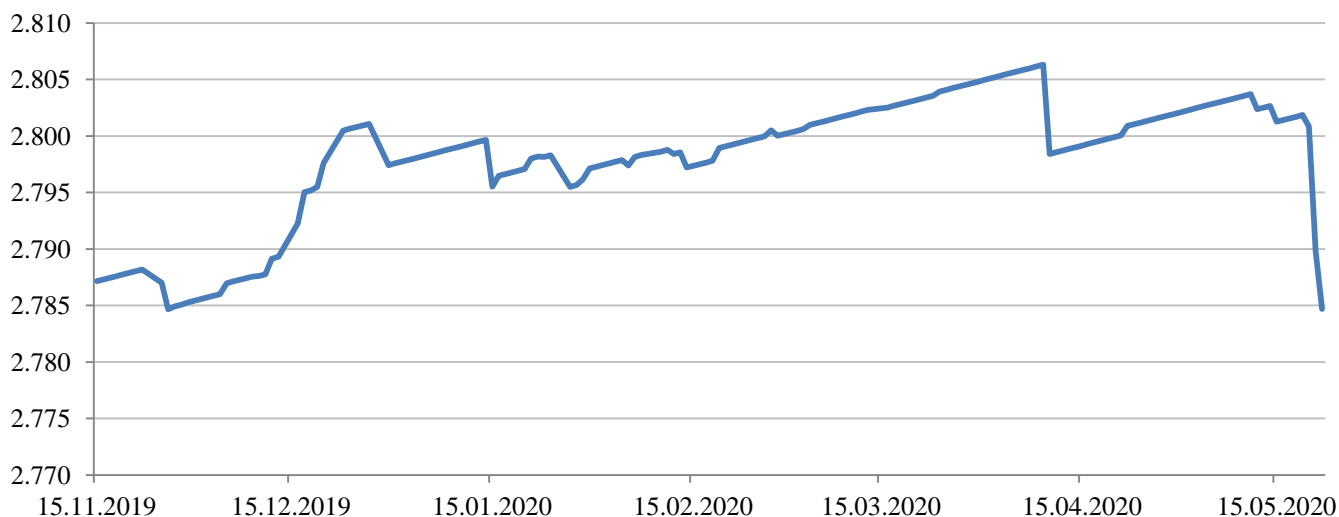
Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 22.05.2020. godine imala rast od 178,47% i na dan 22.05.2020. godine vrijednost ORS-a iznosi 2.784,69 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)



U periodu između sedamnaeste redovne i osamnaeste redovne revizije ORS-a (od 15.11.2019. do 22.05.2020. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila pad vrijednost od -0,09%.

ORS (od 15.11.2019. do 22.05.2020. godine)



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 15.11.2019.	Učešće u ORS-u na dan 15.11.2019.	Cijena na dan 22.05.2020.	Učešće u ORS-u na dan 22.05.2020.	Promjena cijene
RSDS-O-H	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 8	101,2	45,04%	100	45,00%	-1,19%
RSRS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	98,3	7,80%	97	7,79%	-1,32%
RSRS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	97,75	8,16%	97	8,19%	-0,77%
RSRS-O-K	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	97,43	11,06%	96	11,02%	-1,47%
RSRS-O-L	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	96,8	27,93%	96	28,01%	-0,83%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (-0,09%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (-1,09%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (1,00%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 22.05.2020.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 22.05.2020.	Učešće u indeksu
1.	RSRS-O-M	15.125.492	1,50%	11.11.2032	83,96%	12.449.716,75	93,2	42,34%
2.	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	26.10.2023	15,57%	7.293.780,26	99,57	26,50%
3.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	24,59%	2.805.182,59	96	9,83%
4.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	14,75%	1.837.065,96	97	6,50%
5.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	21,31%	1.801.658,76	97	6,38%
6.	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	22.12.2025	11,48%	1.027.079,55	97,6	3,66%
7.	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	29.05.2025	12,30%	617.001,89	98,6	2,22%
8.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	40,98%	554.424,18	96	1,94%
9.	RSDS-O-H	45.304.600	2,50%	29.09.2023	12,30%	173.433,35	100	0,63%
10.	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	28.06.2023	7,38%	3.184.755,69	99	
11.	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	13.12.2023	8,20%	1.914.746,06	99,55	
12.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	8,20%	1.063.124,27	98,35	
13.	RSRS-O-D	35.996.199	1,50%	13.06.2024	7,38%	474.948,05	98,85	
14.	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	05.06.2025	9,02%	313.393,88	98,6	
15.	RSBD-O08	100.000.000	2,89%	27.01.2023	0,82%	281.141,25	102,7	
16.	RSDS-O-G	33.870.590	2,50%	19.08.2021	3,28%	8.891,92	100,50	

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.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	RSRS-O-M	93,2	12.449.716,75
2.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 3	RSRS-O-C	99,57	7.293.780,26
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	RSRS-O-K	96	2.805.182,59
4.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	RSRS-O-I	97	1.837.065,96
5.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	RSRS-O-J	97	1.801.658,76
6.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	RSRS-O-G	97,6	1.027.079,55
7.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	RSRS-O-F	98,6	617.001,89
8.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	96	554.424,18
9.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 8	RSDS-O-H	100	173.433,35

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,004126%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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