

Broj: 12-186/24
Datum: 17.05.2024. godine

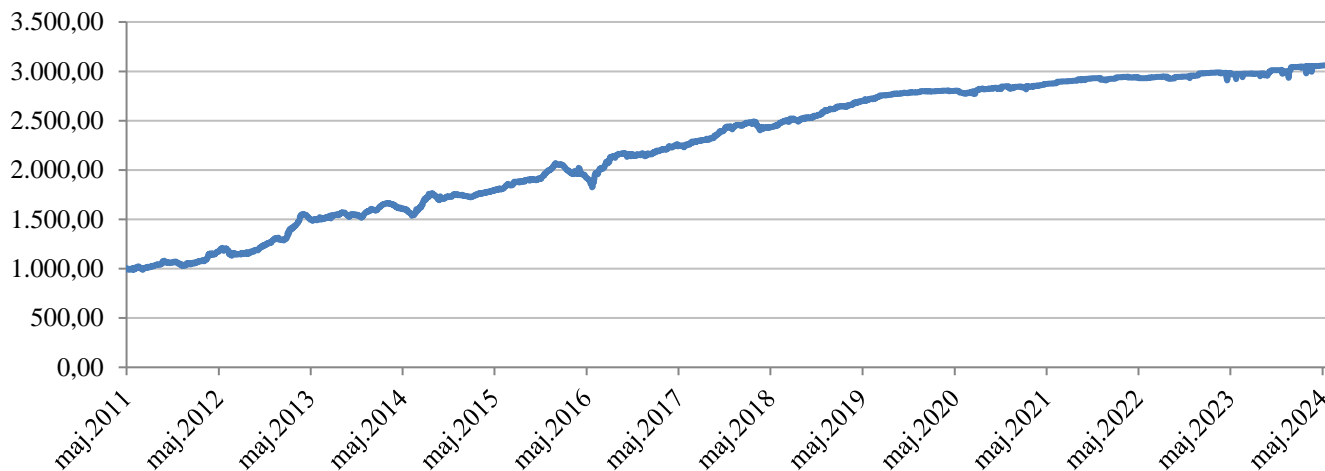
DVADESET ŠESTA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)

I Analiza vrijednosti ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 17.05.2024. godine izvršila dvadeset šestu redovnu reviziju ORS-a.

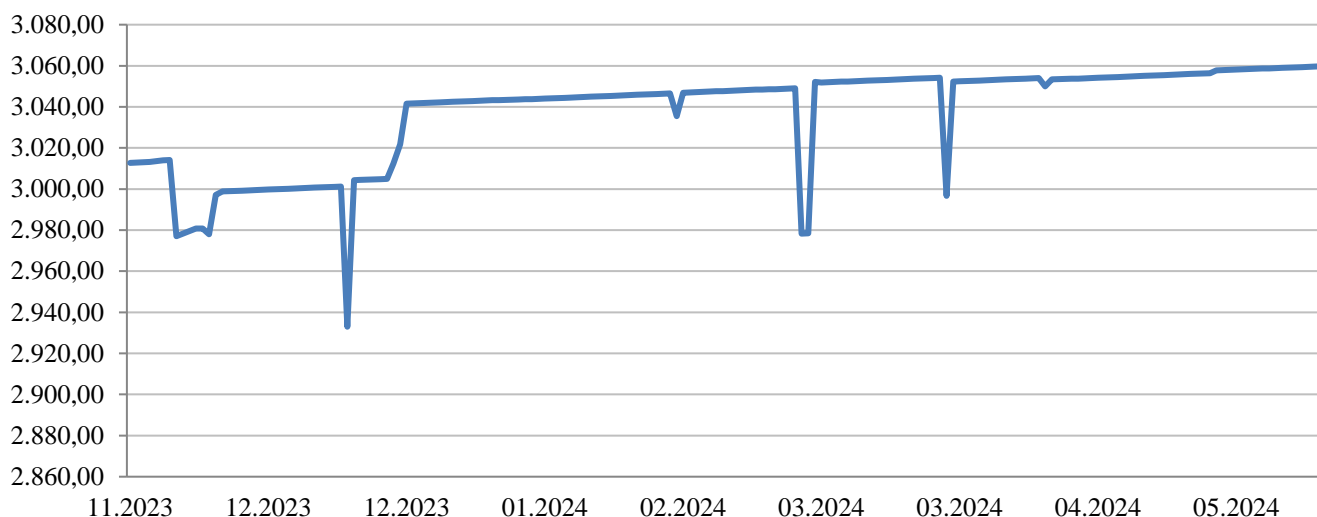
Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 17.05.2024. godine imala rast od 205,99% i na dan 17.05.2024. godine vrijednost ORS-a iznosi 3.059,87 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)



U periodu između dvadeset pete redovne i dvadeset šeste redovne revizije ORS-a (od 17.11.2023. do 17.05.2024. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 1,56%.

ORS (od 17.11.2023. do 16.05.2024. godine)



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 17.11.2023.	Učešće u ORS-u na dan 17.11.2023.	Cijena na dan 17.05.2024.	Učešće u ORS-u na dan 17.05.2024.	Promjena cijene
RSDS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 9	100	5,42%	100	5,37%	0,00%
RSDS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 10	94,5	3,46%	98	3,56%	3,70%
RSRS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	97,95	1,43%	95,79	1,39%	-2,21%
RSRS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	97,94	5,30%	97	5,21%	-0,96%
RSRS-O-K	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	97,81	2,75%	96,98	2,70%	-0,85%
RSRS-O-L	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	96,63	6,69%	96,63	6,64%	0,00%
RSRS-O-M	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	97,4	29,92%	97,99	29,87%	0,61%
RSRS-O-N	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 14	97,2	3,84%	97,2	3,81%	0,00%
RSRS-O-R	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 16	85,75	41,19%	86,94	41,44%	1,39%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (1,56%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (0,78%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (0,79%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 17.05.2024.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 17.05.2024.	Učešće u indeksu
1.	RSBD-O41	45.000.000	6,10%	03.07.2028	7,14%	561.990,00	110	35,97%
2.	RSBD-O39	210.000.000	6,10%	20.06.2028	2,38%	251.100,00	103	15,05%
3.	RSRS-O-R	3.299.834	1,50%	30.08.2035	9,52%	174.600,61	86,94	8,83%
4.	RSBD-O45	30.000.000	6,10%	11.12.2028	3,33%	125.355,00	109,95	8,02%
5.	RSDS-O-J	5.666.849	2,50%	27.07.2027	3,17%	116.940,28	98	6,67%

6.	RSBD-O42	35.000.000	6,10%	02.08.2028	2,38%	112.116,00	100,16	6,53%
7.	RSRS-O-N	5.825.691	1,50%	18.10.2033	3,17%	84.078,00	97,2	4,76%
8.	RSDS-O-I	10.290.916	2,50%	27.07.2026	3,17%	72.588,90	100	4,22%
9.	RSBD-O46	40.000.000	6,00%	07.02.2029	10,64%	66.220,80	105	4,05%
10.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	3,97%	32.003,66	97	1,81%
11.	RSRS-O-M	15.125.492	1,50%	11.11.2032	6,35%	28.703,18	97,99	1,64%
12.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	5,56%	20.275,85	96,98	1,14%
13.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	3,97%	17.283,44	96,63	0,97%
14.	RSBD-O47	40.000.000	6,00%	06.03.2029	3,23%	4.200,00	100	0,24%
15.	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	22.12.2025	2,38%	1.560,64	98,9	0,09%
16.	RSBD-O32	50.000.000	5,00%	13.09.2029	0,79%	7.000.000,00	100,00	
17.	RSRS-O-S	2.236.287	1,50%	16.10.2036	57,94%	739.189,17	74,74	

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 6,10% 05/07/28	RSBD-O41	110	561.990,00
2.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA 6,10% 22/06/28	RSBD-O39	103	251.100,00
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 16	RSRS-O-R	86,94	174.600,61
4.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA 5,8% 13/12/28	RSBD-O45	109,95	125.355,00
5.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 10	RSDS-O-J	98	116.940,28
6.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA 6,10% 04/08/28	RSBD-O42	100,16	112.116,00
7.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 14	RSRS-O-N	97,2	84.078,00
8.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 9	RSDS-O-I	100	72.588,90
9.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA 6 % 09/02/29	RSBD-O46	105	66.220,80
10.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	RSRS-O-J	97	32.003,66
11.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	RSRS-O-M	97,99	28.703,18
12.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	RSRS-O-K	96,98	20.275,85
13.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	96,63	17.283,44
14.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA 6 % 08/03/29	RSBD-O47	100	4.200,00
15.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	RSRS-O-G	98,9	1.560,64

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,012800%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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