

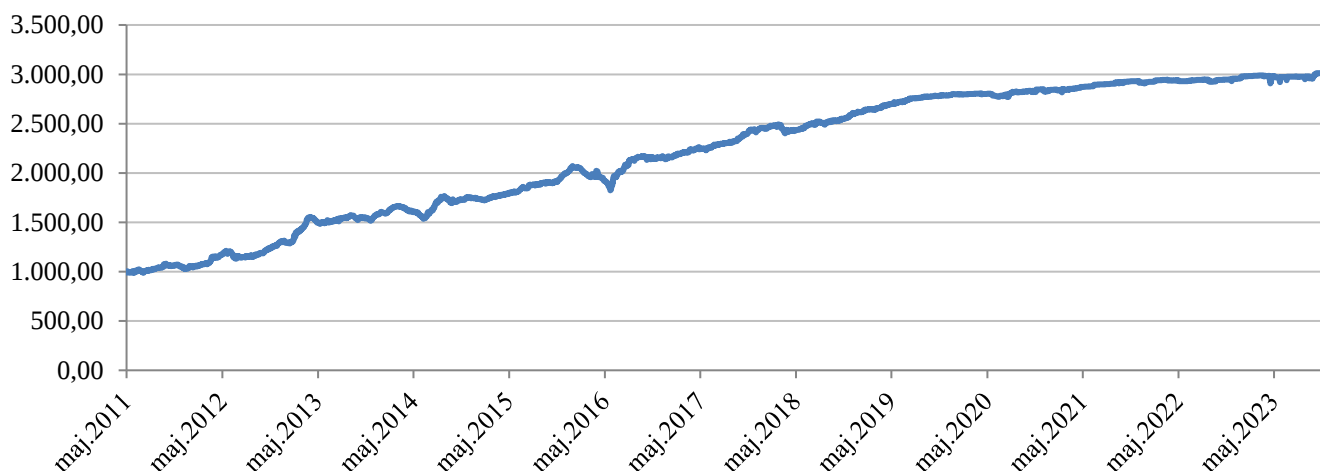
Broj: 12-434/23

Datum: 17.11.2023. godine

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

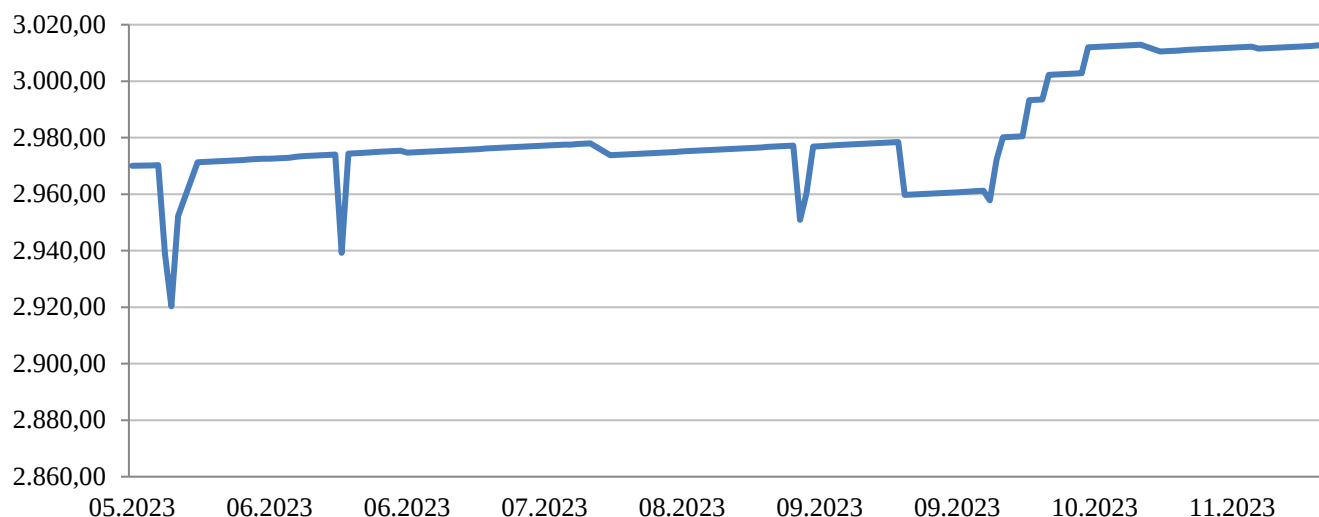
Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 17.11.2023. godine izvršila dvadeset petu redovnu reviziju ORS-a.

Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 17.11.2023. godine imala rast od 201,27% i na dan 17.11.2023. godine vrijednost ORS-a iznosi 3.012,73 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)

U periodu između dvadeset četvrte redovne i dvadeset pete redovne revizije ORS-a (od 19.05.2023. do 17.11.2023. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 1,44%.

ORS (od 19.05.2023. do 17.11.2023. godine)



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 19.05.2023.	Učešće u ORS-u na dan 19.05.2023.	Cijena na dan 17.11.2023.	Učešće u ORS-u na dan 17.11.2023.	Promjena cijene
RSRS-O-K	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	97,97	31,31%	97,81	31,05%	-0,16%
RSRS-O-L	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	96,98	29,87%	96,63	29,56%	-0,36%
RSRS-O-M	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	95,32	38,82%	97,4	39,39%	2,18%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (1,44%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (0,69%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (0,75%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 17.11.2023.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 17.11.2023.	Učešće u indeksu
1.	RSRS-O-R	3.299.834	1,50%	30.08.2035	27,91%	331.594,27	85,75	41,19%
2.	RSRS-O-M	15.125.492	1,50%	11.11.2032	11,63%	212.082,77	97,4	29,92%
3.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	6,98%	47.819,82	96,63	6,69%
4.	RSDS-O-I	10.290.916	2,50%	27.07.2026	3,88%	37.386,80	100	5,42%
5.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	6,20%	37.378,06	97,94	5,30%
6.	RSRS-O-N	5.825.691	1,50%	18.10.2033	3,88%	27.299,48	97,2	3,84%
7.	RSDS-O-J	5.666.849	2,50%	27.07.2027	2,33%	25.268,87	94,5	3,46%
8.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	5,43%	19.380,10	97,81	2,75%
9.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	3,88%	10.089,54	97,95	1,43%
10.	RSBD-O32	50.000.000	5,00%	13.09.2029	1,55%	18.000.000,00	100	

11.	RSBD-O36	30.000.000	5,50%	21.02.2028	1,55%	32.019,60	100	
12.	RSBD-O30	40.000.000	4,50%	20.07.2027	0,78%	10.300,00	103	
13.	RSBD-O20	25.000.000	3,10%	06.06.2025	0,78%	10.110,00	101,1	
14.	RSBD-O41	45.000.000	6,10%	03.07.2028	1,27%	10.030,00	103	
15.	RSBD-O38	20.868.000	5,80%	03.05.2028	0,84%	8.800,00	110	
16.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	0,78%	6.335,36	98,99	
17.	RSRS-O-P	8.150.169	1,50%	02.11.2034	0,78%	5.808,00	96,80	
18.	RSBD-O33	30.000.000	5,00%	12.10.2027	0,78%	3.300,00	110,00	
19.	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	05.06.2025	1,55%	2.930,32	99	
20.	RSBD-O40	30.000.000	6,10%	03.07.2030	1,27%	2.000,00	100	
21.	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	29.05.2025	1,55%	1.132,00	98,5	
22.	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	13.12.2023	0,78%	921,04	99,4	

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 16	RSRS-O-R	85,75	331.594,27
2.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	RSRS-O-M	97,4	212.082,77
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	96,63	47.819,82
4.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 9	RSDS-O-I	100	37.386,80
5.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	RSRS-O-J	97,94	37.378,06
6.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 14	RSRS-O-N	97,2	27.299,48
7.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 10	RSDS-O-J	94,5	25.268,87
8.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	RSRS-O-K	97,81	19.380,10
9.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	RSRS-O-I	97,95	10.089,54

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,004338%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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