

Broj: 12-441/24
Datum: 15.11.2024. godine

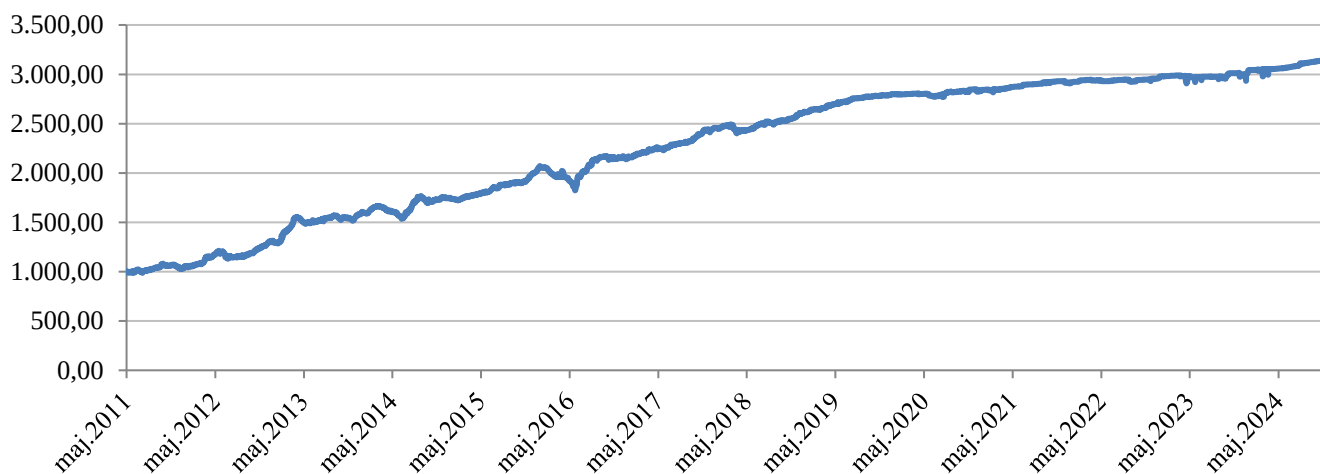
DVADESET SEDMA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)

I Analiza vrijednosti ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 15.11.2024. godine izvršila dvadeset sedmu redovnu reviziju ORS-a.

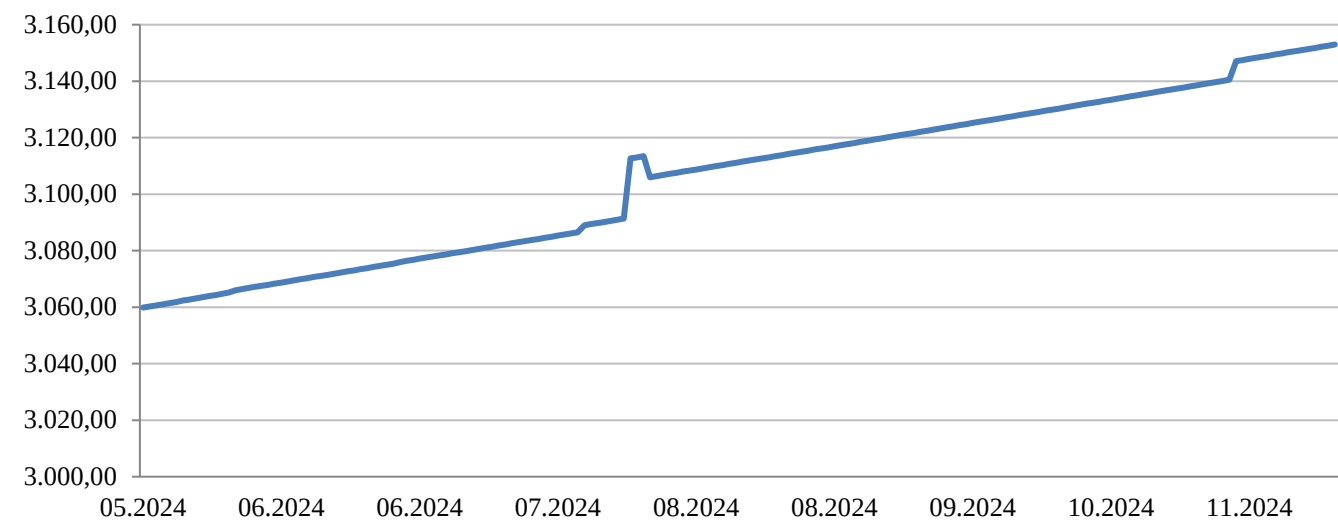
Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 15.11.2024. godine imala rast od 215,34% i na dan 15.11.2024. godine vrijednost ORS-a iznosi 3.153,37 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)



U periodu između dvadeset šeste redovne i dvadeset sedme redovne revizije ORS-a (od 17.05.2024. do 15.11.2024. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 3,06%.

ORS (od 17.05.2024. do 14.11.2024. godine)



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 17.05.2024.	Učešće u ORS-u na dan 17.05.2024.	Cijena na dan 15.11.2024.	Učešće u ORS-u na dan 15.11.2024.	Promjena cijene
RSBD-O39	REPUBLIKA SRPSKA 6,10% 22/06/28	103	15,05%	103	14,94%	0,00%
RSBD-O41	REPUBLIKA SRPSKA 6,10% 05/07/28	110	35,97%	110	35,71%	0,00%
RSBD-O42	REPUBLIKA SRPSKA 6,10% 04/08/28	100,16	6,53%	101,08	6,55%	0,92%
RSBD-O45	REPUBLIKA SRPSKA 5,8% 13/12/28	109,95	8,02%	115	8,33%	4,59%
RSBD-O46	REPUBLIKA SRPSKA 6 % 09/02/29	105	4,05%	105	4,02%	0,00%
RSBD-O47	REPUBLIKA SRPSKA 6 % 08/03/29	100	0,24%	105	0,25%	5,00%
RSDS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 9	100	4,22%	100	4,19%	0,00%
RSDS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 10	98	6,67%	99	6,69%	1,02%
RSRS-O-G	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	98,9	0,09%	98,9	0,09%	0,00%
Ukupno			80,85%		80,77%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (3,06%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (0,73%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (2,33%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 15.11.2024.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 15.11.2024.	Učešće u indeksu
1.	RSBD-O36	30.000.000	5,50%	21.02.2028	7,09%	3.182.000,00	100	45,55%
2.	RSBD-O45	30.000.000	6,10%	11.12.2028	3,15%	1.860.250,00	115	30,62%
3.	RSDS-O-K	6.779.659	2,50%	06.08.2029	73,91%	1.101.504,76	91	14,35%
4.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	3,94%	401.655,36	96,97	5,58%
5.	RSRS-O-R	3.299.834	1,50%	30.08.2035	9,45%	135.126,37	89	1,72%

6.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	5,51%	54.386,20	97,47	0,76%
7.	RSRS-O-M	15.125.492	1,50%	11.11.2032	6,30%	49.826,19	97,98	0,70%
8.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	2,36%	34.722,95	96,99	0,48%
9.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	3,15%	17.204,36	98,99	0,24%
10.	RSBD-O19	144.134.000	3,00%	14.04.2025	1,57%	13.393.222,50	100	
11.	RSBD-O35	30.000.000	5,50%	21.12.2027	1,57%	12.060.000,00	103	
12.	RSBD-O32	50.000.000	5,00%	13.09.2029	0,79%	8.500.000,00	100	
13.	RSRS-O-S	2.236.287	1,50%	16.10.2036	25,98%	211.115,57	74	
14.	RSBD-O34	18.313.000	6,00%	14.12.2032	1,57%	138.000,00	100	
15.	RSBD-O-R	58.712.000	5,00%	01.06.2026	1,57%	130.013,00	100,01	

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 5,50% 23/02/28	RSBD-O36	100	3.182.000,00
2.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA 5,8% 13/12/28	RSBD-O45	115	1.860.250,00
3.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 11	RSDS-O-K	91,01	1.101.504,76
4.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	RSRS-O-K	96,97	401.655,36
5.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 16	RSRS-O-R	89	135.126,37
6.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	97,47	54.386,20
7.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	RSRS-O-M	97,98	49.826,19
8.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	RSRS-O-I	96,99	34.722,95
9.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 8	RSRS-O-H	98,99	17.204,36
10.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA 6 % 09/02/29	RSBD-O46		
11.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA 6,10% 04/08/28	RSBD-O42		
12.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA 6,10% 05/07/28	RSBD-O41		
13.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 10	RSDS-O-J		
14.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA 6 % 08/03/29	RSBD-O47		
15.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 9	RSDS-O-I		

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,013000%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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