



Broj: 12-456/20

Datum: 20.11.2020. godine

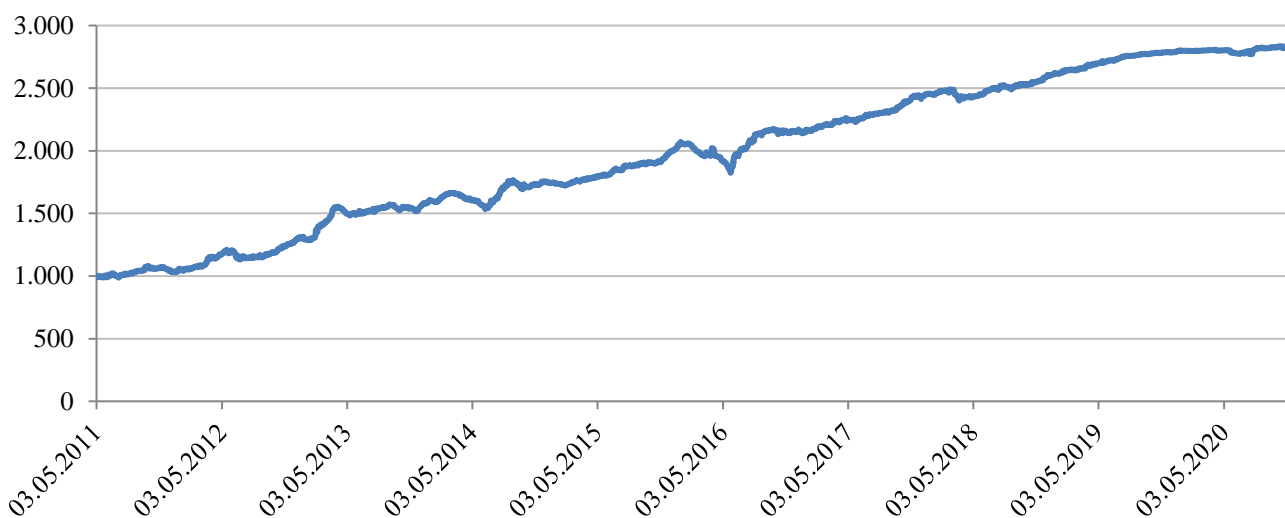
## **DEVETNAESTA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)**

### **I Analiza vrijednosti ORS-a**

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 20.11.2020. godine izvršila devetnaestu redovnu reviziju ORS-a.

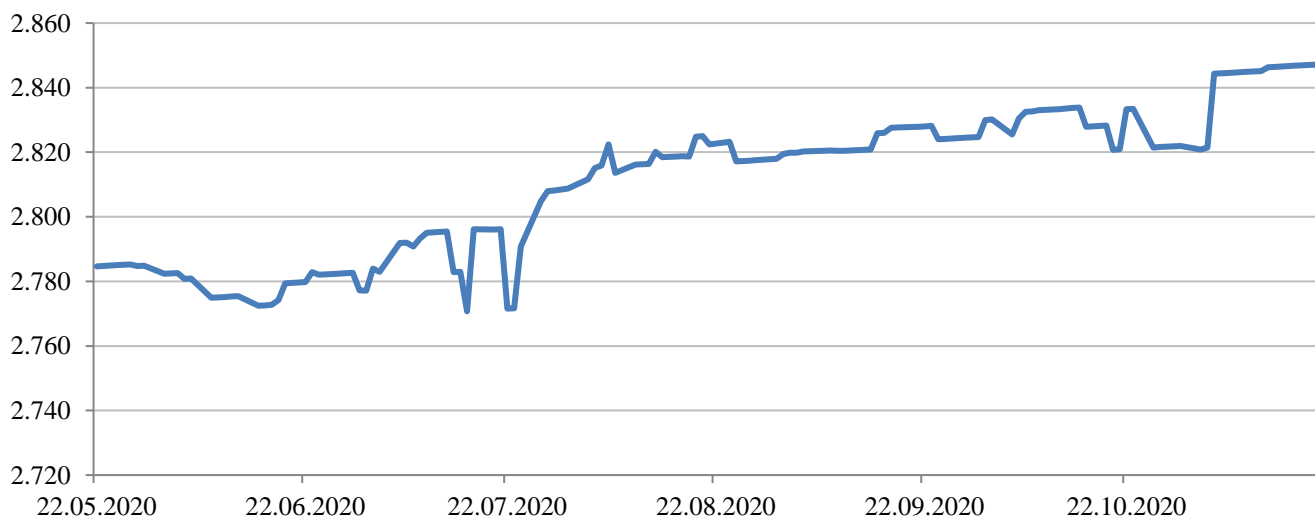
Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 20.11.2020. godine imala rast od 184,72% i na dan 20.11.2020. godine vrijednost ORS-a iznosi 2.847,23 poena.

### **Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)**



U periodu između osamnaeste redovne i devetnaeste redovne revizije ORS-a (od 22.05.2020. do 20.11.2020. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 2,25%.

### **ORS (od 22.05.2020. do 20.11.2020. godine)**



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 22.05.2020.	Učešće u ORS-u na dan 22.05.2020.	Cijena na dan 20.11.2020.	Učešće u ORS-u na dan 20.11.2020.	Promjena cijene
RSDS-O-H	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 8	100	0,63%	100,75	0,63%	0,75%
RSRS-O-C	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 3	99,57	26,50%	99,5	26,09%	-0,07%
RSRS-O-F	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	98,6	2,22%	99	2,20%	0,41%
RSRS-O-G	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	97,6	3,66%	99	3,66%	1,43%
RSRS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	97	6,50%	98	6,47%	1,03%
RSRS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	97	6,38%	97,51	6,32%	0,53%
RSRS-O-K	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	96	9,83%	97,5	9,83%	1,56%
RSRS-O-L	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	96	1,94%	96,6	1,93%	0,62%
RSRS-O-M	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 13	93,2	42,34%	95,8	42,88%	2,79%
	<b>Ukupno</b>		<b>100,00%</b>		<b>100,00%</b>	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (2,25%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (1,50%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (0,75%).

## II Ispunjenost uslova ORS-a na 20.11.2020.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 20.11.2020.	Učešće u indeksu
1.	RSRS-O-M	15.125.492	1,50%	11.11.2032	53,85%	2.077.124,09	95,8	37,96%
2.	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	29.05.2025	13,08%	1.460.116,18	99	27,57%
3.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	27,69%	494.197,09	96,6	9,11%
4.	RSDS-O-H	45.304.600	2,50%	29.09.2023	20,77%	301.509,79	100,75	5,79%
5.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	13,85%	284.025,99	97,5	5,28%
6.	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	28.06.2023	10,00%	256.410,83	99,5	4,87%
7.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	18,46%	146.434,49	97,51	2,72%
8.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	11,54%	128.987,45	98	2,41%
9.	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	22.12.2025	12,31%	116.119,04	99	2,19%
10.	RSRS-O-D	35.996.199	1,50%	13.06.2024	14,62%	110.927,06	99	2,09%
11.	RSBD-O-S	40.000.000	4,00%	30.07.2021	1,54%	10.226.000,00	102,26	
12.	RSBD-O05	35.000.000	3,78%	04.09.2024	0,77%	2.080.000,00	104	
13.	RSRS-O-N	5.825.691	1,50%	18.10.2033	100,00%	558.377,53	91,51	
14.	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	26.10.2023	8,46%	382.150,32	99,5	
15.	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	13.12.2023	6,92%	191.439,97	99,54	
16.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	9,23%	148.135,92	98,00	
17.	RSDS-O-G	33.870.590	2,50%	19.08.2021	1,54%	54.449,09	100,52	
18.	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	05.06.2025	6,92%	23.779,72	98,00	

### 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-izmirenje ratne štete 13	RSRS-O-M	95,8	2.077.124,09
2.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	RSRS-O-F	99	1.460.116,18
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	96,6	494.197,09
4.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 8	RSDS-O-H	100,75	301.509,79
5.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	RSRS-O-K	97,5	284.025,99
6.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 1	RSRS-O-A	99,5	256.410,83
7.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	RSRS-O-J	97,51	146.434,49
8.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	RSRS-O-I	98	128.987,45
9.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	RSRS-O-G	99	116.119,04
10.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 4	RSRS-O-D	99	110.927,06
11.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 3	RSRS-O-C		

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,004200%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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