



Broj: 12-292/16

Datum: 20.05.2016. godine

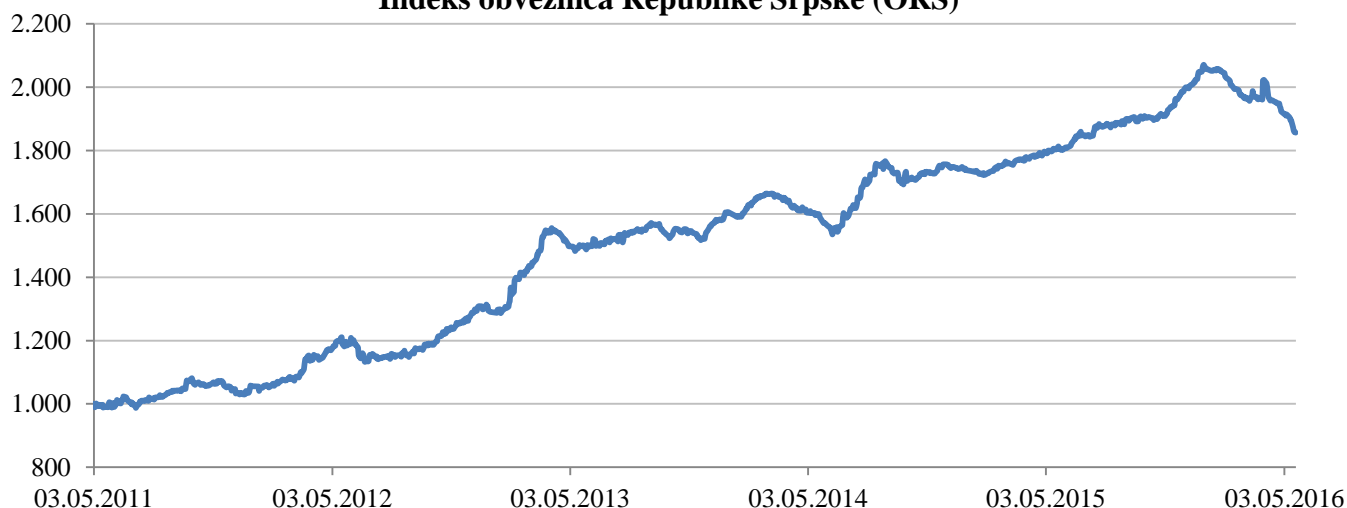
DESETA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)

I Analiza vrijednosti ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 20.05.2016. godine izvršila desetu redovnu reviziju ORS-a.

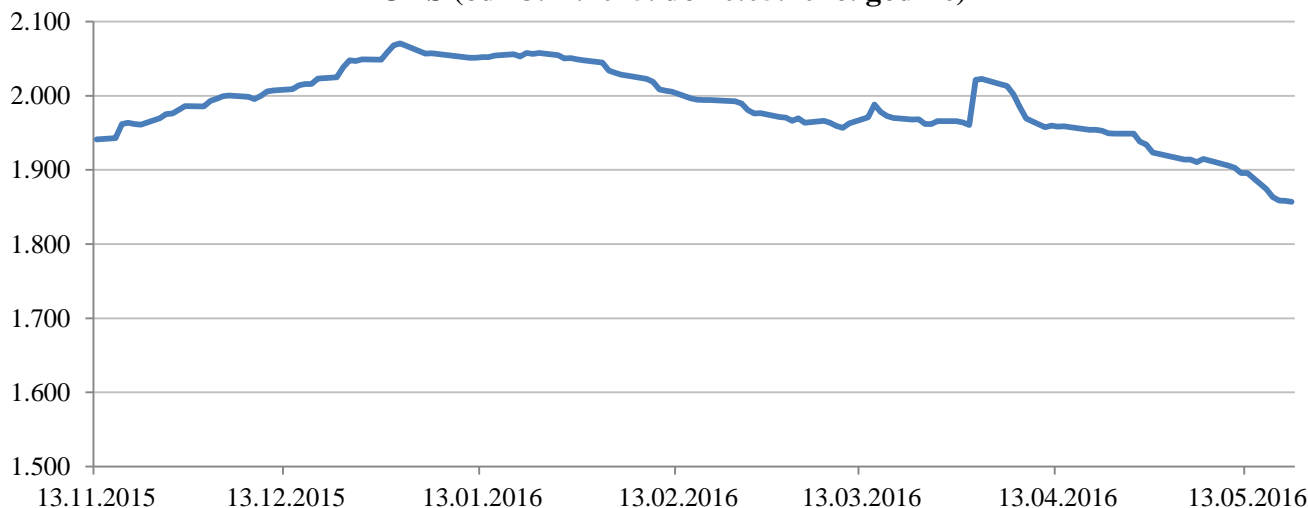
Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 20.05.2016. godine imala rast od 85,69% i na dan 20.05.2016. godine vrijednost ORS-a iznosi 1.856,93 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)



U periodu između devete redovne i desete redovne revizije ORS-a (od 13.11.2015. do 20.05.2016. godine), vrijednost ORS-a je ostvarila pad vrijednost od 4,35%.

ORS (od 13.11.2015. do 20.05.2016. godine)



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 13.11.2015	Učešće u ORS-u na dan 13.11.2015	Cijena na dan 20.05.2016	Učešće u ORS-u na dan 20.05.2016	Promjena cijene
RSDS-O-F	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 6	95,59	13,41%	94	13,91%	-1,66%
RSRS-O-A	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 1	80,93	5,46%	80	5,69%	-1,15%
RSRS-O-B	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 2	82	6,43%	81	6,70%	-1,22%
RSRS-O-C	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 3	80	21,32%	76,7	21,56%	-4,13%
RSRS-O-D	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 4	80	5,24%	80	5,53%	0,00%
RSRS-O-E	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 5	76,92	4,08%	78,49	4,39%	2,04%
RSRS-O-F	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	77,24	18,39%	70,03	17,59%	-9,33%
RSRS-O-G	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	74,9	6,30%	71	6,29%	-5,21%
RSRS-O-H	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 8	72,11	6,46%	67,03	6,33%	-7,04%
RSRS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	72	12,91%	63,5	12,00%	-11,81%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (-4,35%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (-5,18%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (0,83%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 20.05.2016. godine

Redni broj	Oznaka HOV	Nominalna vrijednost	Nominalna kamatna stopa	Datum delistiranja	Procenat trgovanih dana	Promet u posmatраних šest mjeseci (Ponder)	Zatvarajuća cijena na dan 20.05.2016	Učešće u indeksu
1.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	98,68%	9.495.154,01	62,86	39,39%
2.	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	29.05.2025	76,80%	2.075.959,46	70,03	9,59%
3.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	81,60%	1.961.430,52	63,5	8,22%
4.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	59,20%	1.563.099,88	67,03	6,91%
5.	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	26.10.2023	55,20%	1.540.249,79	76,7	7,80%
6.	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	05.06.2025	51,20%	1.427.521,82	78,49	7,39%
7.	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	22.12.2025	42,40%	1.091.277,89	71	5,11%
8.	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	13.12.2023	31,20%	1.070.372,74	81	5,72%
9.	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	28.06.2023	36,80%	982.251,71	80	5,19%
10.	RSRS-O-D	35.996.199	1,50%	13.06.2024	32,00%	884.983,12	80	4,67%
11.	RSIO-O-A	2.908.047	1,50%	20.12.2023	1,60%	6.499,44	79,12	
12.	RSBD-O-J	45.000.000	4,00%	04.07.2019		0,00	100	
13.	RSOD-O-B	542.293	1,50%	13.12.2023	0,80%	1.548,00	80	
14.	RSBD-O-L	35.258.000	4,00%	28.12.2020	3,45%	373.672,40	97,82	
15.	RSDS-O-F	52.555.224	2,50%	12.09.2019	29,60%	1.864.035,89	94	
16.	RSBD-O-M	33.000.000	4,22%	07.02.2019		0,00	98	
17.	RSOD-O-A	1.735.962	1,50%	29.12.2022	1,60%	3.746,79	80,32	
18.	RSBD-O-I	56.000.000	4,01%	03.06.2020		0,00	102,03	
19.	RSBD-O-F	30.000.000	4,98%	20.09.2018		0,00	101,23	
20.	RSBD-O-K	45.000.000	3,35%	19.10.2020		0,00	102,51	
21.	RSBD-O-G	50.000.000	4,48%	29.11.2019		0,00	102,70	
22.	RSBD-O-E	40.000.000	5,60%	14.06.2019		0,00	101,05	
23.	RSBD-O-H	60.000.000	4,50%	07.03.2019		0,00	100,00	
24.	RSDS-O-E	66.287.275	2,50%	26.07.2018	14,40%	666.784,32	96,00	
25.	RSBD-O-D	65.000.000	4,50%	09.04.2018		0,00	100,00	
26.	RSBD-O-B	23.500.000	6,00%	24.04.2019		0,00	100,00	

27.	RSBD-O-N	20.000.000	4,50%	01.03.2023	14,29%	6.000.000,00	100,00	
28.	RSBD-O-A	120.000.000	5,00%	15.11.2018		0,00	92,00	
29.	RSDS-O-D	76.858.467	2,50%	01.09.2017	5,60%	180.989,67	98,50	

III Revizija sastava ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a odlučila je da:

- 1) devet hartija koje su uvrštene u sastav ORS-a, u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a i dalje ispunjavaju uslove za uvrštavanje u sastav indeksa;
- 2) jedna hartija koja više ne ispunjava uslove za uvrštavanje u sastav ORS-a (RSDS-O-F) je isključena iz sastava indeksa;
- 3) jedna hartija koja ispunjava uslove za uvrštavanje u sastav ORS-a (RSRS-O-J) je uključena u sastava indeksa.

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,004110%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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