



Broj: 03-675/15

Datum: 13.11.2015. godine

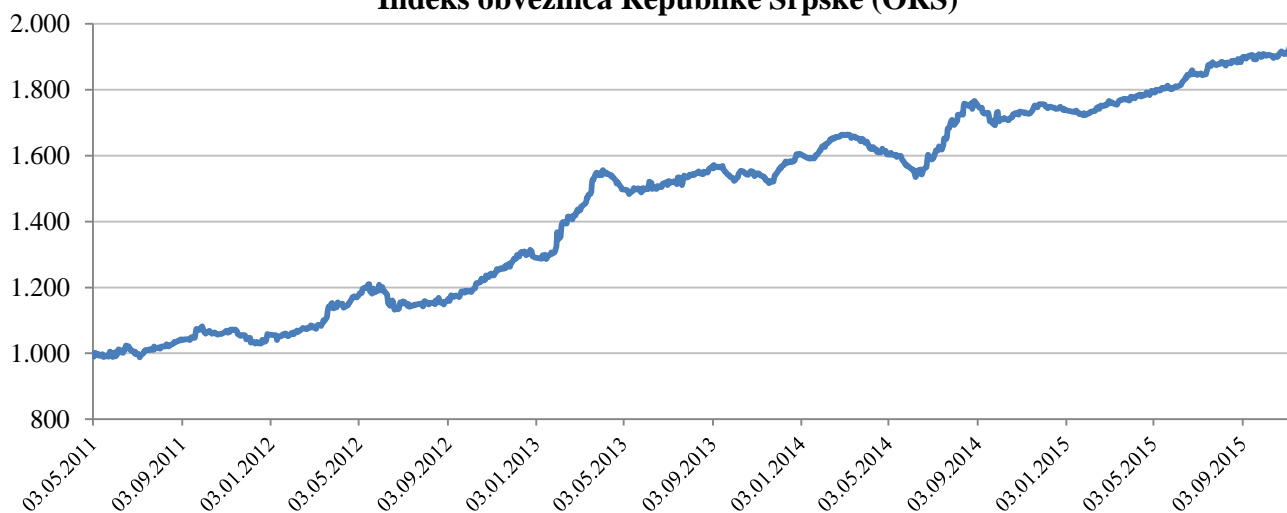
DEVETA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)

I Analiza vrijednosti ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 13.11.2015. godine izvršila devetu redovnu reviziju ORS-a.

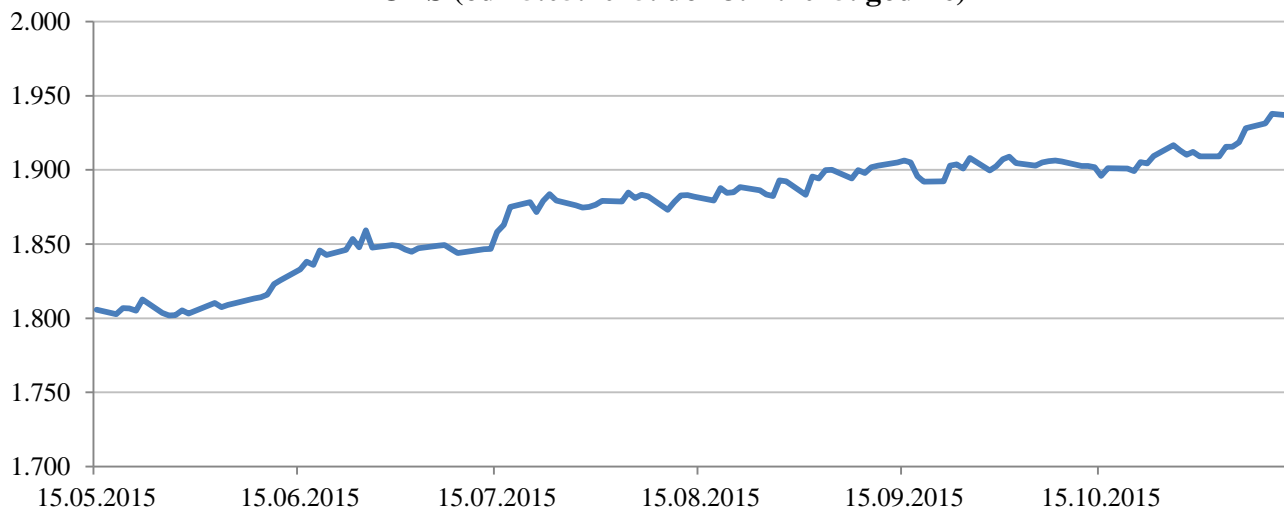
Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 13.11.2015. godine imala rast od 94,14% i na dan 13.11.2015. godine vrijednost ORS-a iznosi 1.941,38 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)



U periodu između osme redovne i devete redovne revizije ORS-a (od 15.05.2015. do 13.11.2015. godine), vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 7,51%.

ORS (od 15.05.2015. do 13.11.2015. godine)



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 15.05.2015.	Učešće u ORS-u na dan 15.05.2015.	Cijena na dan 13.11.2015	Učešće u ORS-u na dan 13.11.2015	Promjena cijene
RSDS-O-F	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 6	93,54	31,53%	95,59	30,22%	2,19%
RSRS-O-A	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 1	77,73	7,05%	80,93	6,89%	4,12%
RSRS-O-B	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 2	76,46	6,68%	82	6,72%	7,25%
RSRS-O-C	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 3	76,5	9,02%	80	8,85%	4,58%
RSRS-O-D	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 4	76,5	3,02%	80	2,96%	4,58%
RSRS-O-E	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 5	71,9	2,76%	76,92	2,77%	6,98%
RSRS-O-F	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	71,71	7,21%	77,24	7,29%	7,71%
RSRS-O-G	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	69	3,13%	74,9	3,19%	8,55%
RSRS-O-H	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 8	66,5	2,76%	72,11	2,81%	8,44%
RSRS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	63,97	26,82%	72	28,31%	12,55%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (7,51%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (6,63%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (0,88%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 13.11.2015. godine

Redni broj	Oznaka HOV	Nominalna vrijednost	Nominalna kamatna stopa	Datum delistiranja	Procenat trgovanih dana	Promet u posmatranih šest mjeseci	Zatvarajuća cijena na dan 13.11.2015	Ponder	Učešće u indeksu
1	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	25.10.2023	75,38%	5.661.825,27	80	5.661.825,27	21,32%
2	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	28.05.2025	86,15%	5.057.446,44	77,24	5.057.446,44	18,39%
3	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	22.09.2027	92,31%	3.807.383,14	72	3.807.383,14	12,91%
4	RSDS-O-F	52.555.224	2,50%	11.09.2019	56,15%	2.979.438,80	95,59	2.979.438,80	13,41%
5	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	22.09.2026	72,31%	1.903.329,54	72,11	1.903.329,54	6,46%
6	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	19.12.2025	53,85%	1.785.445,35	74,9	1.785.445,35	6,30%
7	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	12.12.2023	51,54%	1.665.843,27	82	1.665.843,27	6,43%
8	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	27.06.2023	41,54%	1.433.321,79	80,93	1.433.321,79	5,46%
9	RSRS-O-D	35.996.199	1,50%	12.06.2024	52,31%	1.391.951,90	80	1.391.951,90	5,24%
10	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	04.06.2025	62,31%	1.125.513,16	76,92	1.125.513,16	4,08%
11	RSBD-O-I	56.000.000	4,01%	03.06.2020		0,00	102,03		
12	RSOD-O-A	1.735.962	1,50%	28.12.2022	0,77%	2.654,56	78,5		
13	RSBD-O-D	65.000.000	4,50%	06.04.2018		0,00	100		
14	RSBD-O-G	50.000.000	4,48%	28.11.2019		0,00	102,7		
15	RSOD-O-B	542.293	1,50%	12.12.2023	1,54%	1.474,86	80		
16	RSBD-O-H	60.000.000	4,50%	07.03.2019		0,00	100		
17	RSBD-O-J	45.000.000	4,00%	04.07.2019		0,00	100		
18	RSBD-O-E	40.000.000	5,60%	13.06.2019		0,00	101,05		
19	RSIO-O-A	2.908.047	1,50%	19.12.2023	1,54%	8.167,87	80,00		
20	RSBD-O-B	23.500.000	6,00%	23.04.2019		0,00	100,00		
21	RSBD-O-F	30.000.000	4,98%	19.09.2018		0,00	101,23		
22	RSBD-O-C	6.500.000	6,00%	26.06.2019					
23	RSDS-O-D	76.858.467	2,50%	31.08.2017	11,54%	190.368,73	97,50		
24	RSBD-O-A	120.000.000	5,00%	14.11.2018		0,00	92,00		

25	RSDS-O-E	66.287.275	2,50%	25.07.2018	18,46%	193.194,36	94,01		
----	----------	------------	-------	------------	--------	------------	-------	--	--

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) deset 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;

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,004414%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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