



Broj: 12-189/18

Datum: 18.05.2018. godine

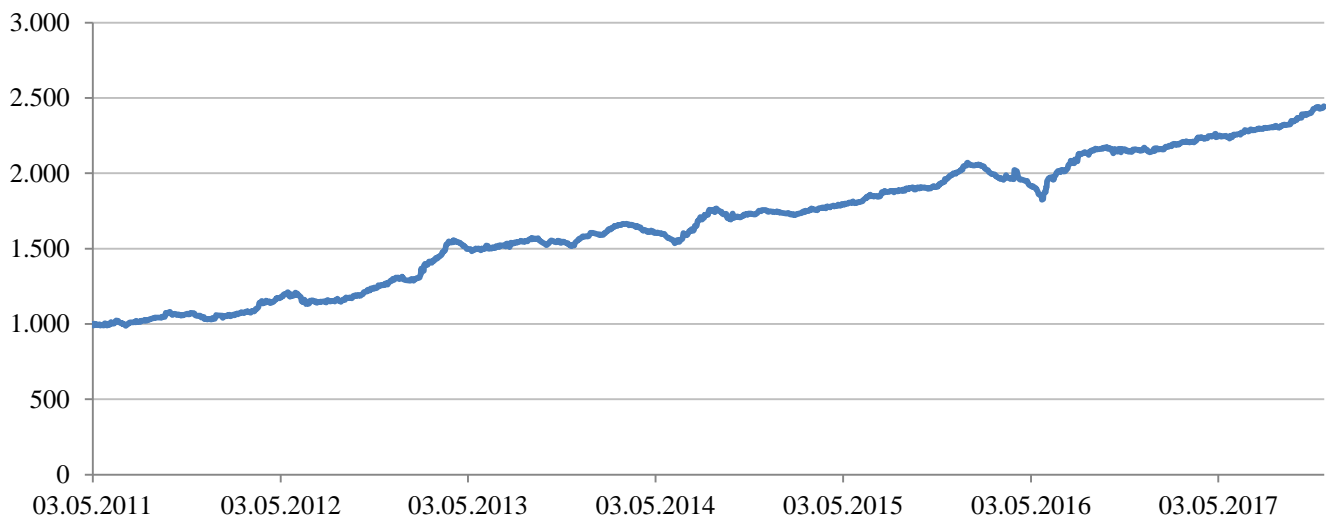
ČETRNAESTA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)

I Analiza vrijednosti ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 18.05.2018. godine izvršila četrnaestu redovnu reviziju ORS-a.

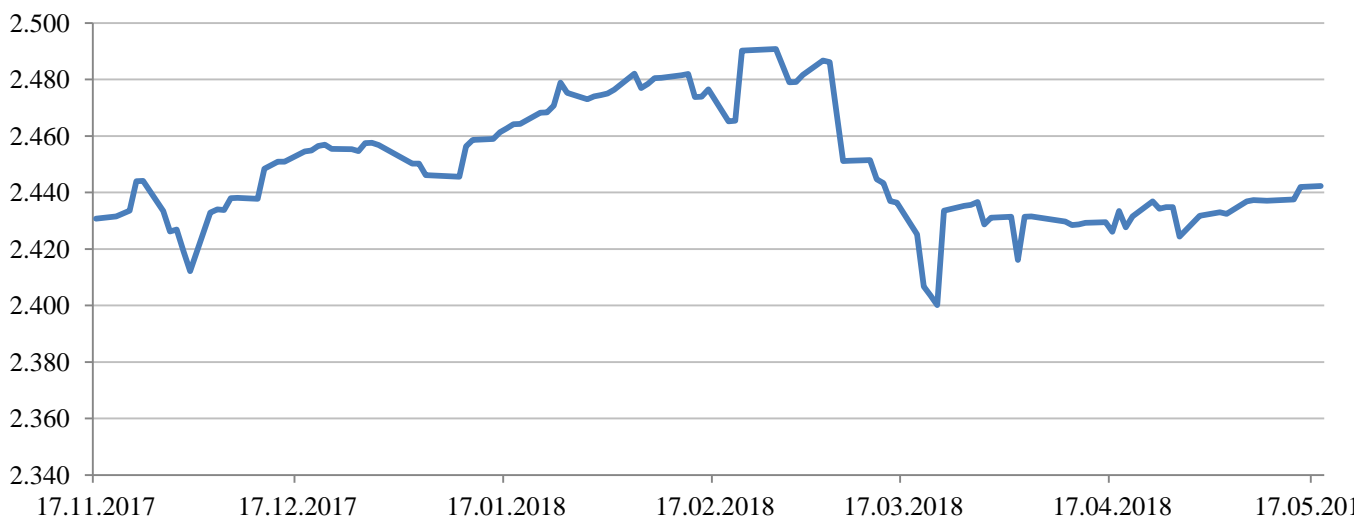
Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 18.05.2018. godine imala rast od 144,23% i na dan 18.05.2018. godine vrijednost ORS-a iznosi 2.442,29 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)



U periodu između trinaeste redovne i četrnaeste redovne revizije ORS-a (od 17.11.2017. do 18.05.2018. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 0,47%.

ORS (od 17.11.2017. do 18.05.2018. godine)



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

Oznaka HOV	Naziv	Cijena na dan 17.11.2017.	Učešće u ORS-u na dan 17.11.2017.	Cijena na dan 18.05.2018.	Učešće u ORS-u na dan 18.05.2018.	Promjena cijene
RSDS-O-G	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 7	98,51	13,24%	98,51	13,29%	0,00%
RSRS-O-C	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 3	93	7,22%	93,4	7,27%	0,43%
RSRS-O-F	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	90	5,25%	91,8	5,37%	2,00%
RSRS-O-G	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	90,2	17,81%	90	17,83%	-0,22%
RSRS-O-H	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 8	88	8,69%	90	8,92%	2,27%
RSRS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	87,5	6,58%	89,5	6,75%	2,29%
RSRS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	86	15,95%	86,5	16,10%	0,58%
RSRS-O-K	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	87	25,26%	84	24,47%	-3,45%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (0,47%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (-0,33%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (0,81%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 18.05.2018.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 18.05.2018.	Učešće u indeksu
1.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	100,00%	11.100.788,05	81,48	58,46%
2.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	30,89%	1.679.130,48	90	9,77%
3.	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	29.05.2025	34,96%	1.576.593,10	91,8	9,35%
4.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	33,33%	1.516.105,54	89,5	8,77%
5.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	63,41%	1.345.418,97	84	7,30%
6.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	49,59%	646.039,76	86,5	3,61%
7.	RSRS-O-D	35.996.199	1,50%	13.06.2024	30,08%	453.463,16	93,04	2,73%
8.	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	28.06.2023	20,33%	1.539.003,76	94,5	
9.	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	22.12.2025	19,51%	1.528.209,29	90	
10.	RSBD-O04	25.000.000	4,00%	02.08.2027	0,81%	1.460.000,00	100	
11.	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	26.10.2023	26,83%	801.372,87	93,4	
12.	RSDS-O-G	33.870.590	2,50%	19.08.2021	8,94%	773.332,98	98,51	
13.	RSDS-O-F	52.555.224	2,50%	12.09.2019	12,20%	145.826,57	99,61	
14.	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	05.06.2025	24,39%	126.977,60	90	
15.	RSDS-O-E	66.287.275	2,50%	26.07.2018	8,94%	118.918,65	99,9	
16.	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	13.12.2023	18,70%	115.579,99	92,02	

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 12	RSRS-O-L	81,48	11.100.788,05
2.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 8	RSRS-O-H	90	1.679.130,48
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	RSRS-O-F	91,8	1.576.593,10
4.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	RSRS-O-I	89,5	1.516.105,54
5.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	RSRS-O-K	84	1.345.418,97
6.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	RSRS-O-J	86,5	646.039,76
7.	Ulazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 4	RSRS-O-D	93,04	453.463,16
8.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 7	RSDS-O-G		
9.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 3	RSRS-O-C		
10.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 7	RSRS-O-G		

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

Komisija za indekse Banjalučke berze

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