



Broj: 12-511/19

Datum: 15.11.2019. godine

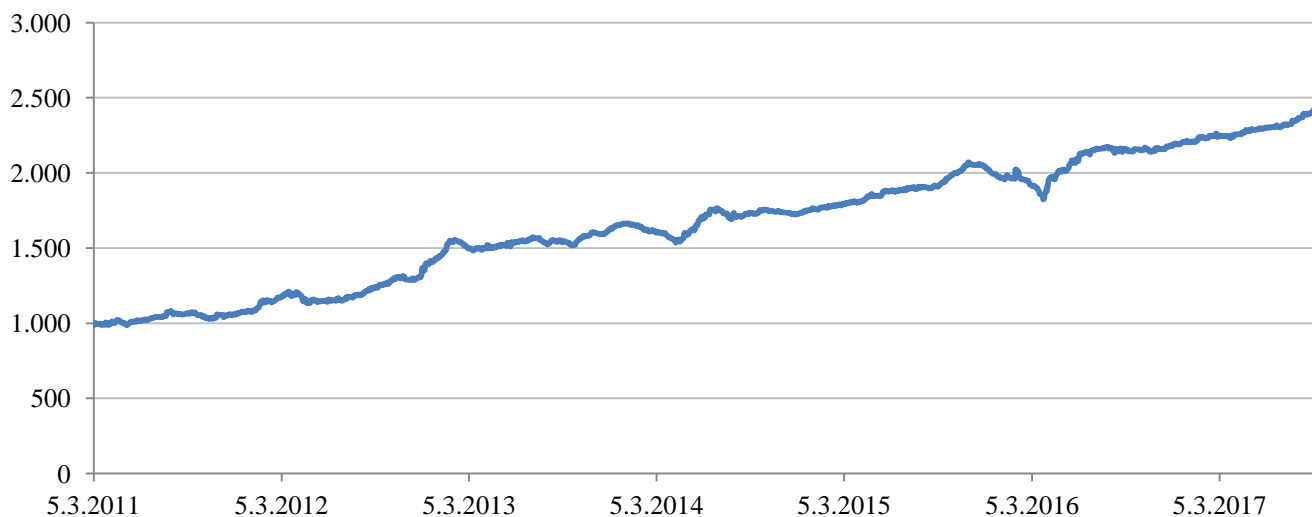
SEDAMNAESTA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)

I Analiza vrijednosti ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 15.11.2019. godine izvršila sedamnaestu redovnu reviziju ORS-a.

Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 15.11.2019. godine imala rast od 178,72% i na dan 15.11.2019. godine vrijednost ORS-a iznosi 2.787,15 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)



U periodu između šesnaeste redovne i sedamnaeste redovne revizije ORS-a (od 17.05.2019. do 15.11.2019. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 3,11%.

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 17.05.2019.	Učešće u ORS-u na dan 17.05.2019.	Cijena na dan 15.11.2019.	Učešće u ORS-u na dan 15.11.2019.	Promjena cijene
RSDS-O-H	REPUBLIKA SRPSKA-stara devizna štednja 8	101	55,36%	101,2	54,33%	0,20%
RSRS-O-F	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	96	1,82%	98,58	1,83%	2,69%
RSRS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	94,8	10,78%	98,3	10,94%	3,69%
RSRS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	94	1,99%	97,75	2,02%	3,99%
RSRS-O-K	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	92,16	14,21%	97,43	14,72%	5,72%
RSRS-O-L	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	93	15,84%	96,8	16,15%	4,09%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (3,11%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (2,10%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (1,01%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 15.11.2019.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 15.11.2019.	Učešće u indeksu
1.	RSDS-O-H	45.304.600	2,50%	29.09.2023	58,14%	3.094.620,27	101,2	45,04%
2.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	60,47%	2.006.407,10	96,8	27,93%
3.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	53,49%	789.370,36	97,43	11,06%
4.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	31,78%	580.677,75	97,75	8,16%
5.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	30,23%	551.950,54	98,3	7,80%
6.	RSBD-O08	100.000.000	2,89%	27.01.2023	0,78%	371.935,00	101,9	
7.	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	26.10.2023	18,60%	245.610,79	99,1	
8.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	24,03%	237.153,70	98,3	
9.	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	22.12.2025	11,63%	210.546,49	98,51	
10.	RSDS-O-G	33.870.590	2,50%	19.08.2021	8,53%	200.233,33	101	
11.	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	29.05.2025	19,38%	145.499,49	98,58	
12.	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	05.06.2025	16,28%	130.643,05	98,7	
13.	RSRS-O-D	35.996.199	1,50%	13.06.2024	12,40%	89.039,35	98,85	
14.	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	13.12.2023	7,75%	83.611,84	99	
15.	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	28.06.2023	6,98%	55.721,96	98,95	

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-stara devizna štednja 8	RSDS-O-H	101,2	3.094.620,27
2.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	96,8	2.006.407,10
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	RSRS-O-K	97,43	789.370,36
4.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	RSRS-O-J	97,75	580.677,75
5.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	RSRS-O-I	98,3	551.950,54
6.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	RSRS-O-F		

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,005317%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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