



Broj: 12-544/18

Datum: 30.11.2018. godine

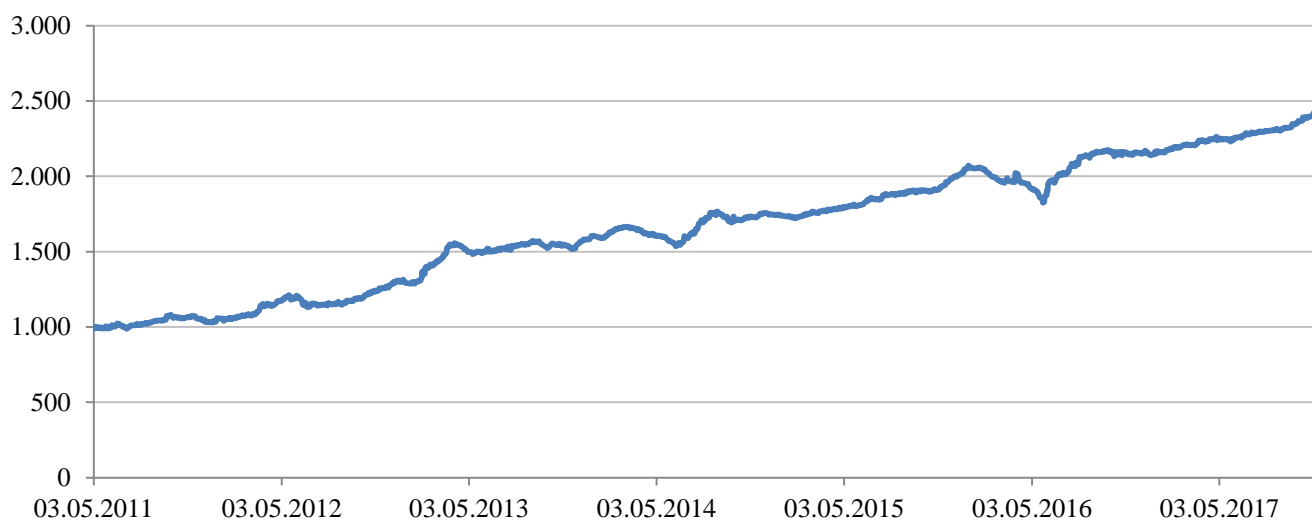
PETNAESTA REDOVNA REVIZIJA INDEKSA OBVEZNICA REPUBLIKE SRPSKE (ORS)

I Analiza vrijednosti ORS-a

Komisija za indekse Banjalučke berze je u skladu sa metodologijom za formiranje, računanje i reviziju ORS-a, dana 30.11.2018. godine izvršila petnaestu redovnu reviziju ORS-a.

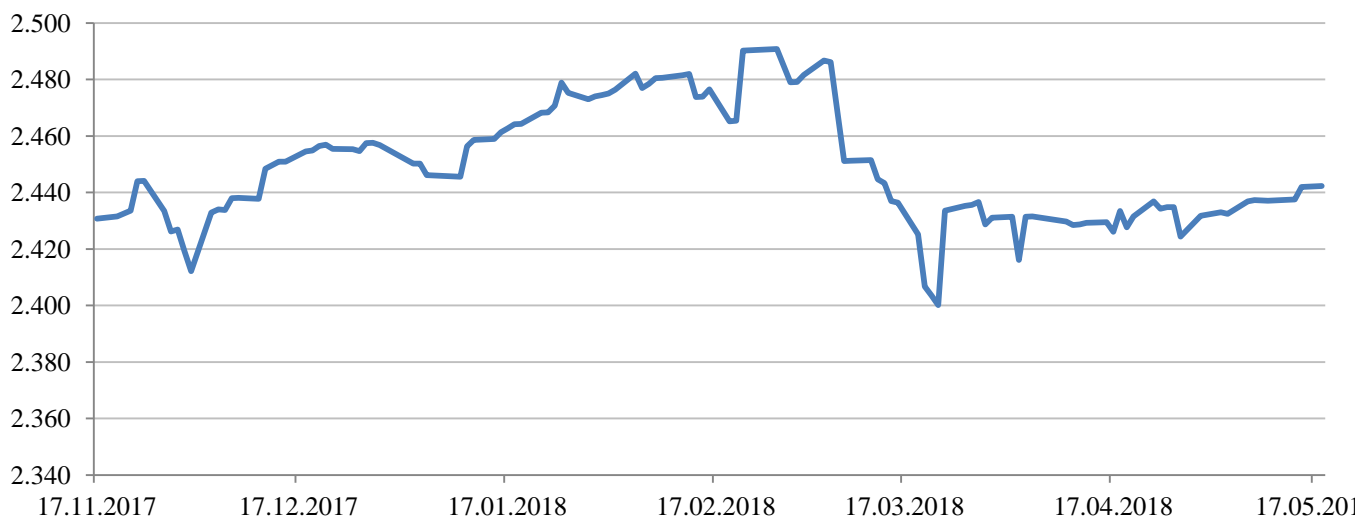
Vrijednost indeksa obveznica Republike Srpske (ORS) je od 3. maja 2011. godine (datum početka računanja) do 30.11.2018. godine imala rast od 159,19% i na dan 30.11.2018. godine vrijednost ORS-a iznosi 2.591,86 poena.

Indeks obveznica Republike Srpske (ORS)



U periodu između četrnaeste redovne i petnaeste redovne revizije ORS-a (od 18.05.2018. do 30.11.2018. godine) vrijednost ORS-a je ostvarila rast vrijednost od 6,12%.

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 18.05.2018.	Učešće u ORS-u na dan 18.05.2018.	Cijena na dan 30.11.2018.	Učešće u ORS-u na dan 30.11.2018.	Promjena cijene
RSRS-O-D	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 4	93,04	2,73%	94,08	2,62%	1,12%
RSRS-O-F	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	91,8	9,35%	93,5	9,05%	1,85%
RSRS-O-H	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 8	90	9,77%	91,5	9,43%	1,67%
RSRS-O-I	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	89,5	8,77%	91,41	8,51%	2,13%
RSRS-O-J	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	86,5	3,61%	90	3,57%	4,05%
RSRS-O-K	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	84	7,30%	90	7,43%	7,14%
RSRS-O-L	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	81,48	58,46%	87,19	59,40%	7,01%
	Ukupno		100,00%		100,00%	

Promjena vrijednosti indeksa između revizija (6,12%) se sastoji od:

- promjene čiste cijene obveznica (5,32%)
- prinosa ponderisane kamatne stope (0,81%).

II Ispunjenost uslova ORS-a na 30.11.2018.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 30.11.2018.	Učešće u indeksu
1.	RSDS-O-H	45.304.600	2,50%	29.09.2023	100,00%	9.501.854,60	100,48	35,65%
2.	RSRS-O-L	26.092.803	1,50%	03.03.2031	94,57%	8.867.878,19	87,19	28,87%
3.	RSRS-O-I	32.185.097	1,50%	23.09.2027	41,09%	5.413.629,33	91,41	18,48%
4.	RSRS-O-J	23.795.791	1,50%	14.12.2028	51,16%	3.483.456,60	90	11,71%
5.	RSRS-O-F	55.449.667	1,50%	29.05.2025	34,88%	832.698,17	93,5	2,91%
6.	RSRS-O-K	21.117.388	1,50%	20.11.2029	65,89%	706.784,87	90	2,38%
7.	RSBD-O08	100.000.000	2,89%	27.01.2023	2,33%	4.203.472,50	102,15	
8.	RSBD-O01	35.000.000	2,50%	11.03.2022	0,78%	3.174.300,00	105,81	
9.	RSRS-O-H	27.301.604	1,50%	23.09.2026	22,48%	658.594,05	91,5	
10.	RSRS-O-C	80.545.470	1,50%	26.10.2023	21,71%	520.372,56	96	
11.	RSRS-O-D	35.996.199	1,50%	13.06.2024	24,81%	497.942,99	94,08	
12.	RSDS-O-F	52.555.224	2,50%	12.09.2019	24,03%	457.189,11	99,75	
13.	RSRS-O-G	21.818.286	1,50%	22.12.2025	14,73%	399.617,76	93,21	
14.	RSRS-O-E	29.103.835	1,50%	05.06.2025	22,48%	391.802,51	93,5	
15.	RSDS-O-G	33.870.590	2,50%	19.08.2021	14,73%	333.696,81	100	
16.	RSRS-O-B	27.868.713	1,50%	13.12.2023	16,28%	243.622,31	96,49	
17.	RSRS-O-A	40.764.772	1,50%	28.06.2023	12,40%	133.905,43	96,50	

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-stara devizna štednja 8	RSDS-O-H	100,48	9.501.854,60
2.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 12	RSRS-O-L	87,19	8.867.878,19
3.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 9	RSRS-O-I	91,41	5.413.629,33
4.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 10	RSRS-O-J	90	3.483.456,60
5.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 6	RSRS-O-F	93,5	832.698,17
6.	Ostaje	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 11	RSRS-O-K	90	706.784,87
7.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 8	RSRS-O-H		
8.	Izlazi	REPUBLIKA SRPSKA-izmirenje ratne štete 4	RSRS-O-D		

Ponderisana dnevna kamatna stopa za naredni period iznosi 0,005013%.

Komisija za indekse Banjalučke berze

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