

# Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-märts-2018

## 1. Üldinfo

### 1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	411 694 107
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-500 577
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	6 219 377
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	-500 577

### 1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	1 200
Väljamaksed aasta algusest:	0

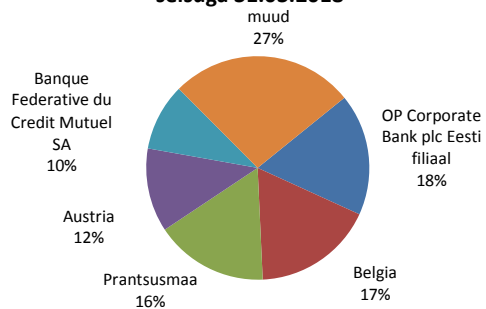
### 1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulus 90 päeva (aasta baasil)	-0,49%	-0,53%	0,04%
Tulus 12 kuud (aasta baasil)	-0,40%	-0,44%	0,04%
Tulus aasta algusest (aasta baasil)	-0,49%	-0,53%	0,04%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,73	0,50	0,23

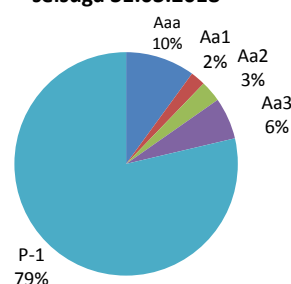
### 1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	66,56%	100%		274 021 967
krediidiasutus	33,44%	35%	1,56%	137 672 140
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	10,06%			41 432 672
Aa1	2,16%			8 897 964
Aa2	3,04%			12 520 172
Aa3	6,05%			24 919 479
P-1	78,68%			323 923 820
Suuremad investeeringud krediidiasutuse/emitendi lõikes				
OP Corporate Bank plc Eesti filiaal	17,66%	20%	2,34%	72 693 181
Belgia	17,49%	20%	2,51%	71 997 073
Prantsusmaa	16,33%	20%	3,67%	67 230 060
Austria	12,16%	20%	7,84%	50 069 100
Banque Federative du Credit Mutuel S.	9,73%	20%	10,27%	40 059 480
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	82,34%			339 000 926
hoius	17,00%			70 000 000
kontojääk	0,65%			2 693 181
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	411 694 107

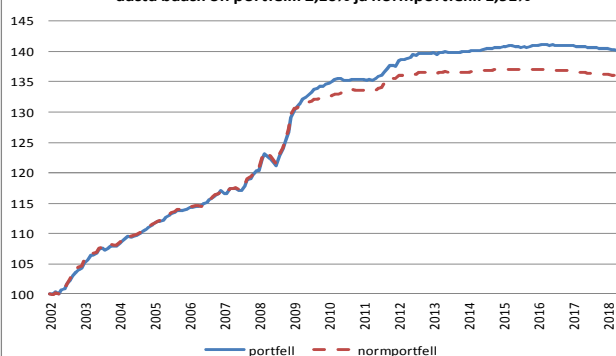
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes  
seisuga 31.03.2018



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes  
seisuga 31.03.2018



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulus aasta baasil on portfelli 2,10% ja normportfelli 1,91%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulus

