

# Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 30-juuni-2018

## 1. Üldinfo

### 1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	412 485 640
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	791 533
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-445 280
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	290 956

### 1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	1 082 975
Väljamaksed aasta algusest:	0

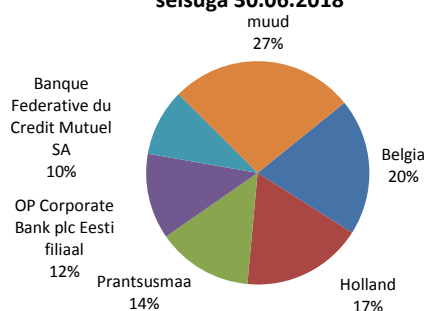
### 1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	-0,28%	-0,42%	0,14%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	-0,37%	-0,41%	0,04%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	-0,38%	-0,48%	0,09%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,68	0,45	0,23

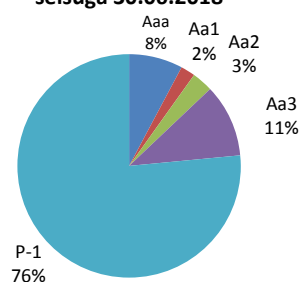
### 1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	66,32%	100%		273 559 050
krediidiasutus	33,68%	35%	1,32%	138 926 590
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	7,79%			32 112 182
Aa1	2,09%			8 632 159
Aa2	3,05%			12 597 710
Aa3	10,55%			43 530 867
P-1	76,51%			315 612 721
Suuremad investeeringud krediidasutuse/emitendi lõikes				
Belgia	19,86%	20%	0,14%	81 919 271
Holland	17,44%	100%	82,56%	71 946 461
Prantsusmaa	13,86%	20%	6,14%	57 155 570
OP Corporate Bank plc Eesti filiaal	12,43%	20%	7,57%	51 263 320
Banque Federative du Credit Mutuel S.	9,72%	20%	10,28%	40 075 840
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	87,57%			361 222 320
hoius	9,70%			40 000 000
kontojääk	2,73%			11 263 320
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	412 485 640

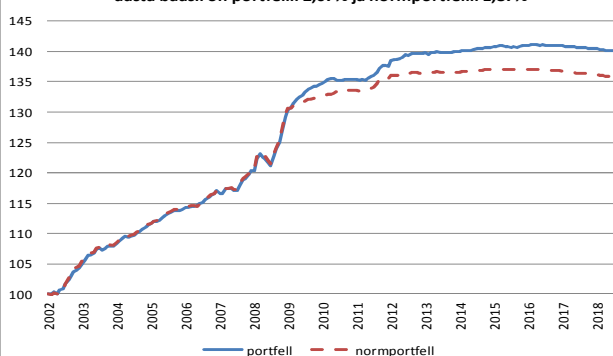
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes  
seisuga 30.06.2018



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes  
seisuga 30.06.2018



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulusus  
aasta baasil on portfelli 2,07% ja normportfelli 1,87%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulusus

