

Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 30-juuni-2019

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	415 392 353
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	3 612 684
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	2 906 714
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	3 884 427

1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	3 481 521
Väljamaksed aasta algusest:	0

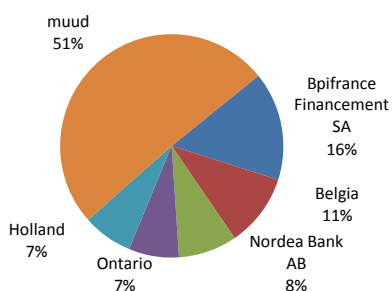
1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	0,13%	-0,23%	0,36%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	-0,14%	-0,36%	0,22%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	0,20%	-0,36%	0,55%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,83	0,60	0,23

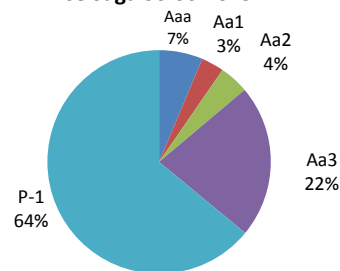
1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	67,50%	100%		280 403 983
krediitiasutus	32,50%	35%	2,50%	134 988 371
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	6,34%			26 326 004
Aa1	3,26%			13 535 687
Aa2	4,28%			17 763 312
Aa3	22,12%			91 877 166
P-1	64,01%			265 890 184
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Bpifrance Financement SA	15,73%	20%	4,27%	65 351 902
Belgia	10,57%	20%	9,43%	43 924 612
Nordea Bank AB	8,49%	20%	11,51%	35 279 521
Ontario	7,28%	20%	12,72%	30 227 387
Holland	7,23%	100%	92,77%	30 046 200
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	99,05%			411 454 812
hoius	0,00%			0
kontojääk	0,95%			3 937 542
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	415 392 353

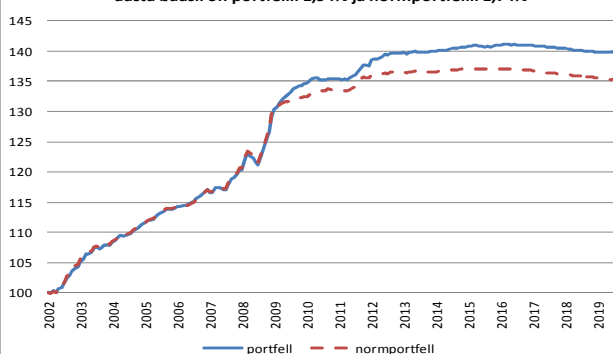
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes
seisuga 30.06.2019



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes
seisuga 30.06.2019



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulusus
aasta baasil on portfelli 1,94% ja normportfelli 1,74%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulusus

