

Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 30-sept-2018

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	411 952 014
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-533 626
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-632 821
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	-242 670

1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	1 085 375
Väljamaksed aasta algusest:	0

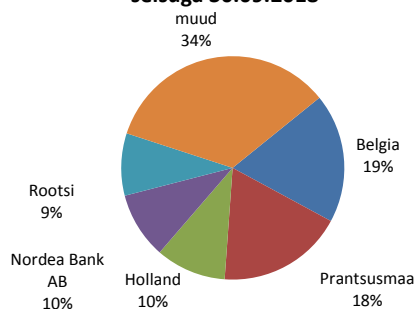
1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	-0,52%	-0,32%	-0,20%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	-0,42%	-0,41%	0,00%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	-0,43%	-0,42%	0,00%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,83	0,55	0,28

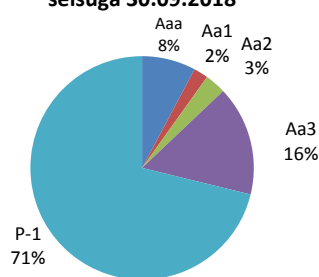
1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	65,11%	100%		268 209 322
krediidiasutus	34,89%	35%	0,11%	143 742 692
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	7,78%			32 053 437
Aa1	2,09%			8 607 974
Aa2	3,03%			12 502 256
Aa3	15,93%			65 606 629
P-1	71,17%			293 181 719
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Belgia	18,74%	20%	1,26%	77 182 870
Prantsusmaa	18,24%	20%	1,76%	75 146 900
Holland	10,20%	100%	89,80%	42 032 570
Nordea Bank AB	9,64%	20%	10,36%	39 731 878
Rootsi	9,04%	100%	90,96%	37 220 374
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	96,73%			398 470 190
hoius	0,00%			0
kontojääk	3,27%			13 481 823
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	411 952 014

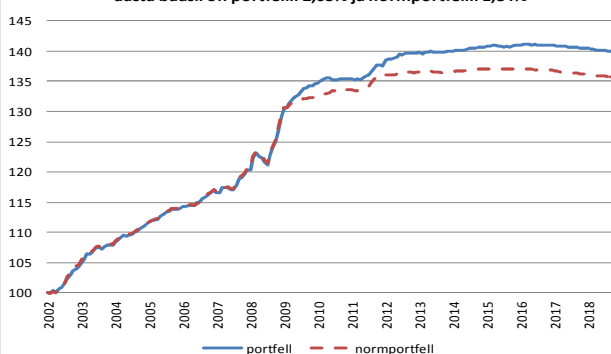
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes
seisuga 30.09.2018



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes
seisuga 30.09.2018



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulusus
aasta baasil on portfelli 2,03% ja normportfelli 1,84%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulusus

