

Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-dets-2017

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	412 194 684
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-390 151
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	6 249 019
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	6 249 019

1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	7 856 567
Väljamaksed aasta algusest:	0

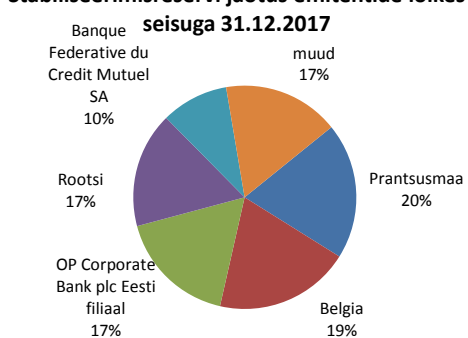
1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	-0,38%	-0,38%	0,01%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	-0,39%	-0,46%	0,07%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	-0,39%	-0,46%	0,07%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,60	0,53	0,07

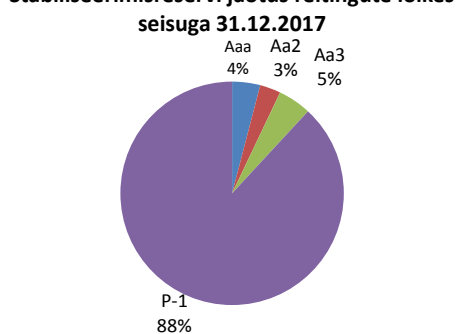
1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	68,16%	100%		280 971 162
krediidiasutus	31,84%	35%	3,16%	131 223 521
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	4,05%			16 677 416
Aa2	3,04%			12 531 002
Aa3	4,82%			19 885 895
P-1	88,09%			363 100 371
Suuremad investeeringud krediidiasutuse/emitendi lõikes				
Prantsusmaa	19,74%	20%	0,26%	81 360 720
Belgia	19,67%	20%	0,33%	81 091 200
OP Corporate Bank plc Eesti filiaal	17,28%	20%	2,72%	71 247 546
Rootsi	16,72%	100%	83,28%	68 903 041
Banque Federative du Credit Mutuel S.	9,73%	20%	10,27%	40 090 080
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	82,72%			340 947 137
hoius	16,98%			70 000 000
kontojääk	0,30%			1 247 546
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	412 194 684

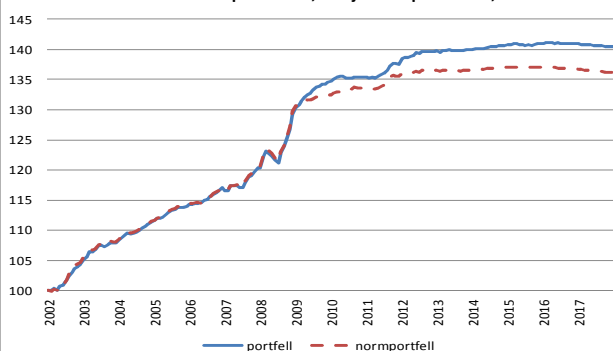
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulusus aasta baasil on portfelli 2,14% ja normportfelli 1,95%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulusus

