

Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-dets-2018

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	411 507 926
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-444 087
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-686 757
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	-686 757

1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	1 086 575
Väljamaksed aasta algusest:	0

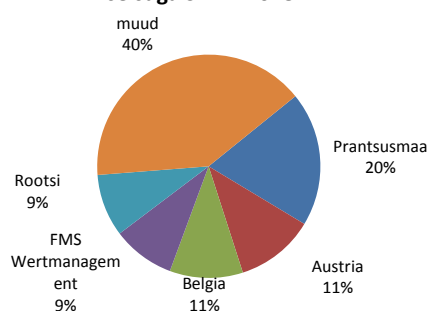
1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulus 90 päeva (aasta baasil)	-0,43%	-0,40%	-0,03%
Tulus 12 kuud (aasta baasil)	-0,43%	-0,42%	-0,01%
Tulus aasta algusest (aasta baasil)	-0,43%	-0,42%	-0,01%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,90	0,49	0,41

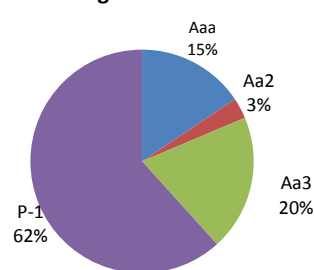
1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	65,15%	100%		268 083 940
krediidiasutus	34,85%	35%	0,15%	143 423 986
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	15,62%			64 264 631
Aa2	3,02%			12 436 682
Aa3	19,64%			80 839 129
P-1	61,72%			253 967 485
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Prantsusmaa	19,46%	20%	0,54%	80 065 300
Austria	11,42%	20%	8,58%	47 011 050
Belgia	10,61%	20%	9,39%	43 655 610
FMS Wertmanagement	9,06%	20%	10,94%	37 268 210
Rootsi	9,03%	100%	90,97%	37 174 536
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	99,90%			411 081 073
hoius	0,00%			0
kontojääk	0,10%			426 854
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	411 507 926

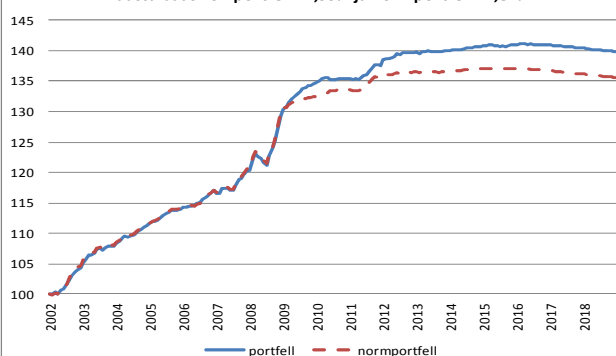
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes
seisuga 31.12.2018



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes
seisuga 31.12.2018



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulus aasta baasil on portfelli 1,99% ja normportfelli 1,81%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulus

