

# Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-märts-2019

## 1. Üldinfo

### 1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	411 779 669
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	271 743
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	85 562
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	271 743

### 1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	1 440
Väljamaksed aasta algusest:	0

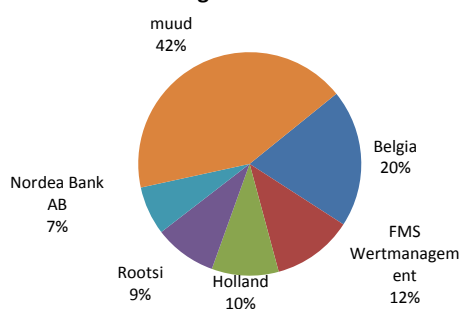
### 1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	0,26%	-0,49%	0,75%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	-0,24%	-0,41%	0,17%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	0,26%	-0,49%	0,75%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,90	0,56	0,34

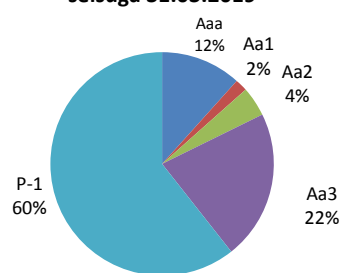
### 1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	65,19%	100%		268 434 935
krediidiasutus	34,81%	35%	0,19%	143 344 734
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	11,66%			48 015 127
Aa1	1,76%			7 266 618
Aa2	4,29%			17 651 405
Aa3	21,67%			89 229 686
P-1	60,62%			249 616 833
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Belgia	19,97%	20%	0,03%	82 250 480
FMS Wertmanagement	11,66%	20%	8,34%	48 015 127
Holland	9,72%	100%	90,28%	40 027 680
Rootsi	9,01%	100%	90,99%	37 120 080
Nordea Bank AB	7,04%	20%	12,96%	28 989 235
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	99,00%			407 658 621
hoius	0,00%			0
kontojääk	1,00%			4 121 048
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	411 779 669

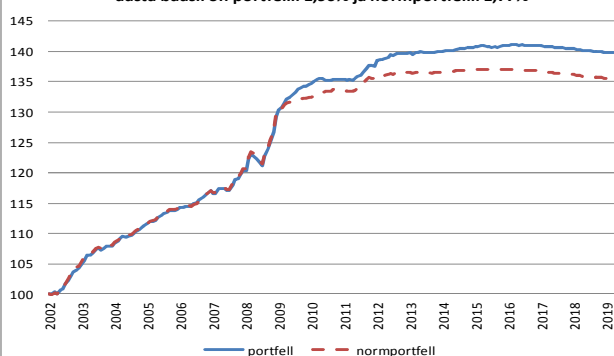
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes  
seisuga 31.03.2019



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes  
seisuga 31.03.2019



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulusus  
aasta baasil on portfelli 1,96% ja normportfelli 1,77%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulusus

