

# Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-märts-2020

## 1. Üldinfo

### 1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	411 068 691
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-3 304 744
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-710 978
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	-3 304 744

### 1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	1 200
Väljamaksed aasta algusest:	0

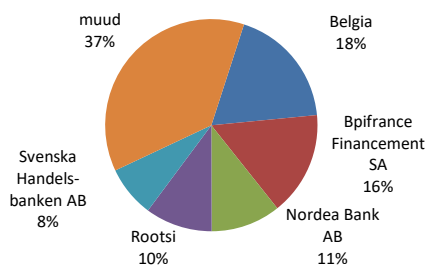
### 1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulus 90 päeva (aasta baasil)	-3,15%	-1,61%	-1,54%
Tulus 12 kuud (aasta baasil)	-1,01%	-0,70%	-0,31%
Tulus aasta algusest (aasta baasil)	-3,15%	-1,61%	-1,54%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,86	0,51	0,35

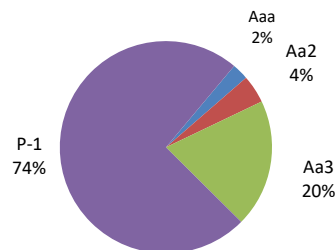
### 1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	70,42%	100%		289 475 918
krediidiasutus	27,72%	35%	5,42%	113 945 508
ettevõtte	1,86%			7 647 264
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	2,53%			10 397 135
Aa2	4,26%			17 509 726
Aa3	19,55%			80 355 117
P-1	73,66%			302 806 714
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Belgia	18,45%	20%	1,55%	75 857 348
Bpifrance Financement SA	15,84%	20%	4,16%	65 132 311
Nordea Bank AB	10,65%	20%	9,35%	43 787 547
Rootsi	10,25%	100%	89,75%	42 115 920
Svenska Handelsbanken AB	7,81%	20%	12,19%	32 124 230
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	98,78%			406 046 098
hoius	0,00%			0
kontojääk	1,22%			5 022 593
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	411 068 691

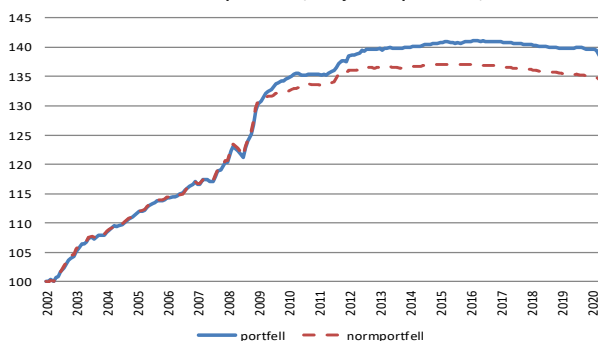
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes  
seisuga 31.03.2020



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes  
seisuga 31.03.2020



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulus aasta baasil on portfellil 1,80% ja normportfellil 1,64%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulus

