

Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 30-juuni-2021

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	431 538 431
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	268 287
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-632 904
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	-383 355

1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	859 608
Väljamaksed aasta algusest:	0

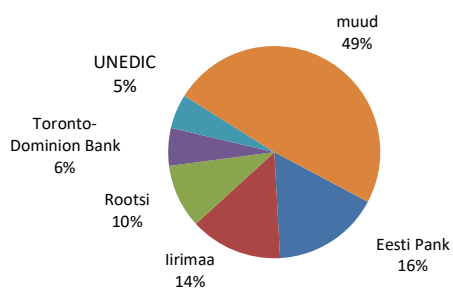
1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulus 90 päeva (aasta baasil)	-0,55%	-0,43%	-0,12%
Tulus 12 kuud (aasta baasil)	-0,35%	-0,41%	0,06%
Tulus aasta algusest (aasta baasil)	-0,57%	-0,50%	-0,08%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	1,22	0,54	0,67

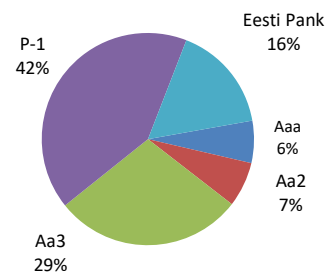
1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	48,84%			210 780 996
keskpank	16,33%	100%		70 491 191
krediitiasutus	32,51%	35%	0,18%	140 303 930
ettevõtte	2,31%			9 962 315
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	6,40%			27 615 875
Aa2	6,87%			29 648 604
Aa3	28,73%			123 992 751
P-1	41,66%			179 790 011
Eesti Pank	16,33%			70 491 191
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Eesti Pank	16,33%	100%	83,67%	70 491 191
Iirimaa	14,08%	20%	5,92%	60 778 633
Rootsi	9,70%	100%	90,30%	41 860 526
Toronto-Dominion Bank	5,78%	20%	14,22%	24 952 343
UNEDIC	5,21%	20%	14,79%	22 476 476
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	78,57%			339 048 065
hoius	5,10%			21 999 175
kontojääk	16,33%			70 491 191
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	431 538 431

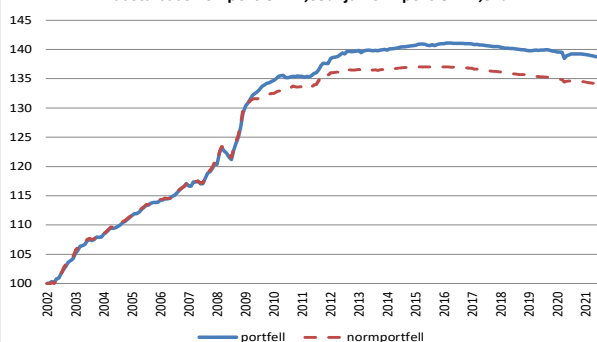
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes
seisuga 30.06.2021



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes
seisuga 30.06.2021



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulus aasta baasil on portfellil 1,69% ja normportfellil 1,52%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulus

