

Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 30-sept-2020

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	432 197 250
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	25 915
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	17 134 629
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	17 823 815

1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	18 885 005
Väljamaksed aasta algusest:	0

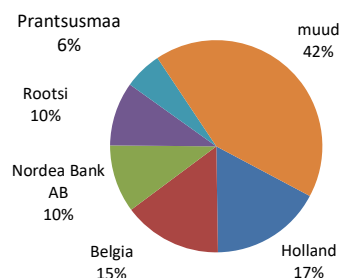
1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	0,02%	-0,21%	0,24%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	-0,43%	-0,44%	0,01%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	-0,36%	-0,43%	0,08%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,74	0,40	0,34

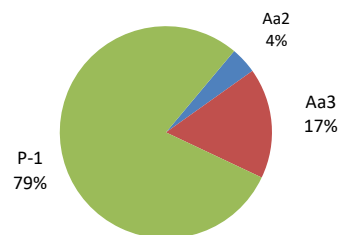
1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	65,11%	100%		281 415 148
krediidiasutus	33,01%	35%	0,11%	142 652 359
ettevõte	1,88%			8 129 744
Investeeringud reitingu alusel				
Aa2	4,05%			17 507 526
Aa3	16,87%			72 891 709
P-1	79,08%			341 798 015
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Holland	16,95%	100%	83,05%	73 249 130
Belgia	15,07%	20%	4,93%	65 125 900
Nordea Bank AB	10,35%	20%	9,65%	44 738 485
Rootsi	9,72%	100%	90,28%	42 008 778
Prantsusmaa	5,79%	20%	14,21%	25 031 000
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	99,99%			432 152 270
hoius	0,00%			0
kontojääk	0,01%			44 979
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	432 197 250

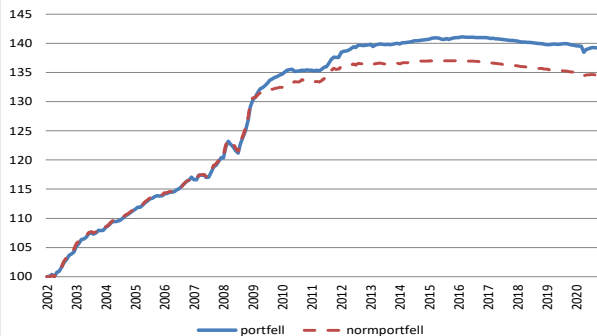
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes
seisuga 30.09.2020



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes
seisuga 30.09.2020



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulusus
aasta baasil on portfellil 1,78% ja normportfellil 1,60%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulusus

