

Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 30-sept-2021

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	431 106 771
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-431 660
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-1 090 479
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	-815 015

1.2. Laekumised, väljamaksed

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

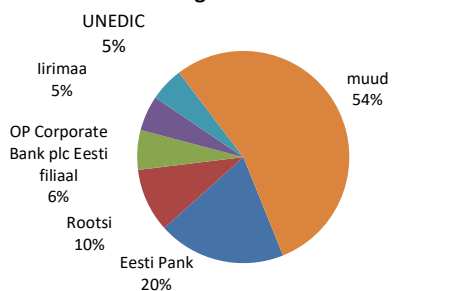
1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulus 90 päeva (aasta baasil)	-0,40%	-0,55%	0,15%
Tulus 12 kuud (aasta baasil)	-0,45%	-0,49%	0,04%
Tulus aasta algusest (aasta baasil)	-0,52%	-0,51%	0,00%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,86	0,47	0,39

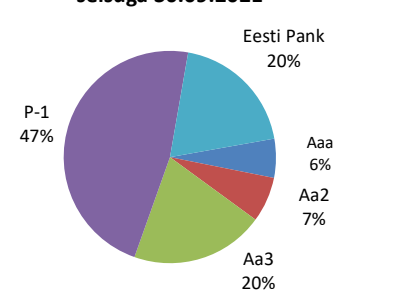
1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	45,78%			197 355 353
keskpank	19,47%	100%		83 933 264
krediidiasutus	28,48%	35%	0,25%	122 773 299
ettevõte	6,27%			27 044 854
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	5,95%			25 659 366
Aa2	6,87%			29 626 838
Aa3	20,37%			87 837 281
P-1	47,33%			204 050 021
Eesti Pank	19,47%			83 933 264
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Eesti Pank	19,47%	100%	80,53%	83 933 264
Rootsi	9,70%	100%	90,30%	41 802 508
OP Corporate Bank plc Eesti filiaal	6,05%	20%	13,95%	26 077 430
Iirimaa	5,34%	20%	14,66%	23 008 280
UNEDIC	5,21%	20%	14,79%	22 461 072
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	69,38%			299 106 129
hoius	5,10%			21 989 947
kontojääk	25,52%			110 010 694
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	431 106 771

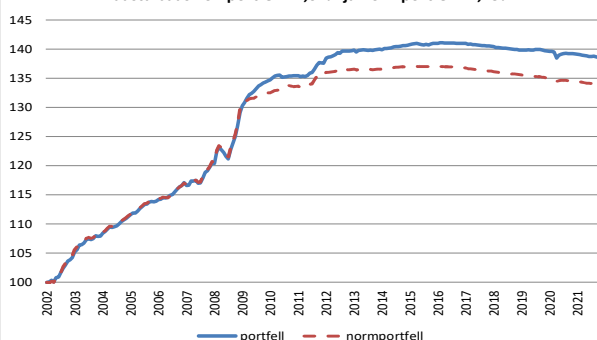
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes seisuga 30.09.2021



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes seisuga 30.09.2021



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulus aasta baasil on portfellil 1,67% ja normportfellil 1,49%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulus

