

Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-dets-2019

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	414 373 435
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-689 186
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	2 865 509
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	2 865 509

1.2. Laekumised, väljamaksed

	Summa (EUR)
Laekumised aasta algusest vastavalt "Riigieelarve seadusele":	3 483 921
Väljamaksed aasta algusest:	0

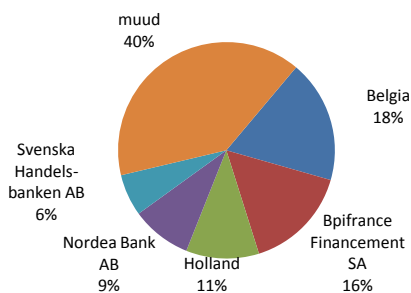
1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	-0,66%	-0,47%	-0,19%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	-0,15%	-0,42%	0,27%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	-0,15%	-0,42%	0,27%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,61	0,49	0,12

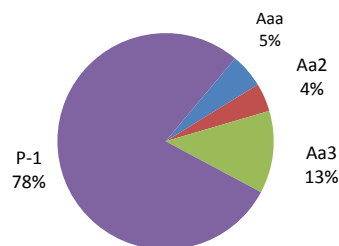
1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	65,33%	100%		270 710 872
krediitiasutus	33,45%	35%	0,33%	138 604 484
ettevõte	1,22%			5 058 078
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	5,12%			21 200 738
Aa2	4,23%			17 538 635
Aa3	12,35%			51 163 432
P-1	78,30%			324 470 629
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Belgia	18,32%	20%	1,68%	75 911 372
Bpifrance Financement SA	15,73%	20%	4,27%	65 190 837
Holland	10,87%	100%	89,13%	45 059 500
Nordea Bank AB	9,01%	20%	10,99%	37 335 214
Svenska Handelsbanken AB	6,25%	20%	13,75%	25 893 033
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	98,53%			408 271 219
hoius	0,00%			0
kontojääk	1,47%			6 102 216
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	414 373 435

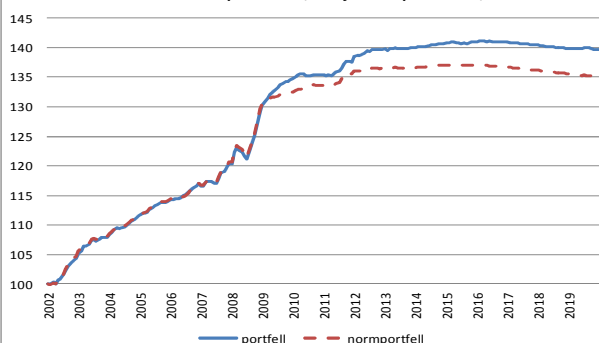
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes seisuga 31.12.2019



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes seisuga 31.12.2019



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulusus aasta baasil on portfellil 1,87% ja normportfellil 1,68%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulusus

