

Aruanne stabiliseerimisreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-dets-2020

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	431 921 785
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-275 464
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	17 548 351
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	17 548 351

1.2. Laekumised, väljamaksed

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

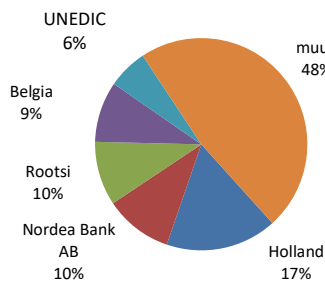
1.3. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Normportfell	Erinevus +/-
Tulus 90 päeva (aasta baasil)	-0,25%	-0,43%	0,18%
Tulus 12 kuud (aasta baasil)	-0,33%	-0,43%	0,10%
Tulus aasta algusest (aasta baasil)	-0,33%	-0,43%	0,10%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,65	0,47	0,18

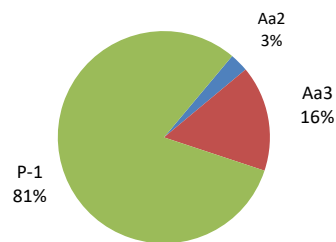
1.4. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	65,09%	100%		281 120 790
krediidiasutus	33,02%	35%	0,09%	142 633 370
ettevõtte	1,89%			8 167 625
Investeeringud reitingu alusel				
Aa2	2,85%			12 323 042
Aa3	16,14%			69 700 614
P-1	81,01%			349 898 130
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Holland	16,94%	100%	83,06%	73 177 330
Nordea Bank AB	10,36%	20%	9,64%	44 745 606
Rootsi	9,72%	100%	90,28%	41 974 599
Belgia	9,27%	20%	10,73%	40 054 400
UNEDIC	6,10%	20%	13,90%	26 328 390
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	99,95%			431 712 387
hoius	0,00%			0
kontojääk	0,05%			209 398
Investeeringud valuuta alusel				
EUR	100,00%	100%	0,00%	431 921 785

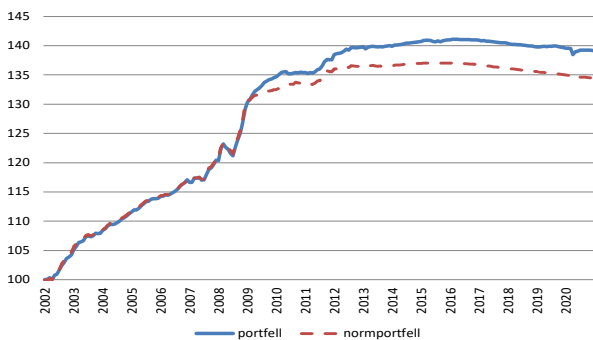
Stabiliseerimisreservi jaotus emitentide lõikes
seisuga 31.12.2020



Stabiliseerimisreservi jaotus reitingute lõikes
seisuga 31.12.2020



Stabiliseerimisreservi ja normportfelli kumulatiivne tulu, tulusus
aasta baasil on portfelliil 1,75% ja normportfelliil 1,57%



Stabiliseerimisreservi turuväärtus ja tulusus

