

Aruanne likviidsusreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 30-juuni-2020

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	2 661 224 744
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	1 892 727 246
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	1 673 378 142
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	1 699 506 202

1.2. Väärtuse kasv/kahanemine

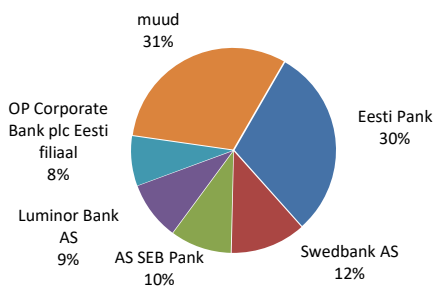
	Portfell	Võrdlusindeks	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	0,35%	-0,46%	0,81%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	-0,18%	-0,44%	0,26%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	-0,31%	-0,46%	0,15%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,08		

1.3. Investeeringute koondandmed

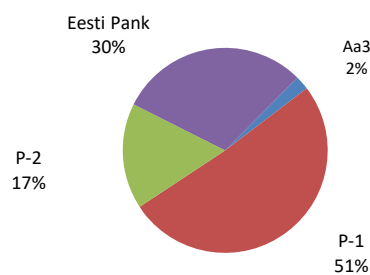
	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	7,52%			200 126 000
krediidiasutus	62,42%			1 661 098 744
keskpank	30,06%			800 000 000
Investeeringud reitingu alusel				
Aa3	2,14%			57 043 162
P-1	51,10%			1 359 969 915
P-2	16,69%			444 211 666
Eesti Pank	30,06%			800 000 000
Suuremad investeeringud krediidiasutuse/emitendi lõikes				
Eesti Pank	30,06%	100%	69,94%	800 000 000
Swedbank AS	11,97%	20%	8,03%	318 545 457
AS SEB Pank	9,75%	20%	10,25%	259 511 190
Luminor Bank AS	9,27%	20%	10,73%	246 639 603
OP Corporate Bank plc Eesti filiaal	7,88%	20%	12,12%	209 802 060
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	23,64%			629 154 364
hoius	0,00%			0
kontojääk	76,36%			2 032 070 380
Investeeringud valuuta alusel*				
EUR	100,00%			2 661 222 443
muud	0,00%	1%	1,00%	2 301

* sh tuletistehingud

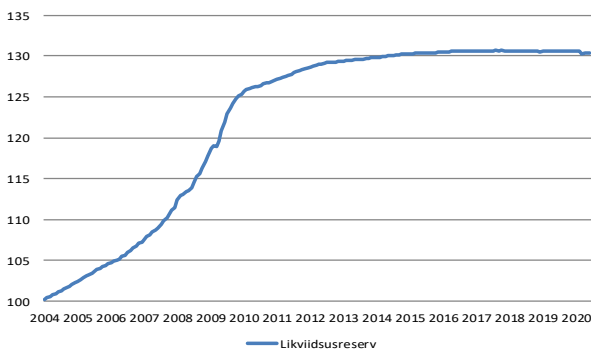
Likviidsusreservi jaotus emitentide lõikes seisuga 30.06.2020



Likviidsusreservi jaotus reitingute lõikes seisuga 30.06.2020



Likviidsusreservi kumulatiivne tulu, tulusus aasta baasil on 1,62%



Likviidsusreservi turuväärtus ja tulusus

