

Aruanne likviidsusreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-dets-2019

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	961 718 542
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-168 819 513
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	285 115 523
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	285 115 523

1.2. Väärtuse kasv/kahanemine

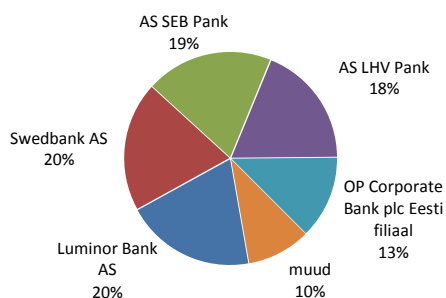
	Portfell	Võrdlusindeks	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	-0,08%	-0,45%	0,37%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	0,06%	-0,39%	0,45%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	0,06%	-0,39%	0,45%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,06		

1.3. Investeeringute koondandmed

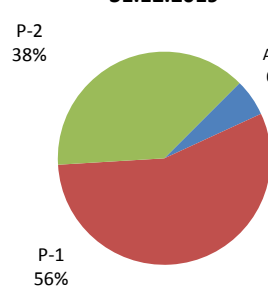
	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
krediitiasutus	99,70%			958 859 736
supranatsionaal	0,30%			2 858 806
Investeeringud reitingu alusel				
Aa3	5,63%			54 164 122
P-1	55,92%			537 812 199
P-2	38,45%			369 742 221
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Luminor Bank AS	19,79%	20%	0,21%	190 355 578
Swedbank AS	19,75%	20%	0,25%	189 931 749
AS SEB Pank	19,42%	20%	0,58%	186 811 446
AS LHV Pank	18,65%	20%	1,35%	179 386 643
OP Corporate Bank plc Eesti filiaal	12,66%	20%	7,34%	121 756 843
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	9,72%			93 476 279
hoius	0,00%			0
kontojääk	90,28%			868 242 263
Investeeringud valuuta alusel*				
EUR	100,00%			961 718 330
muud	0,00%	1%	1,00%	212

* sh tuletistehingud

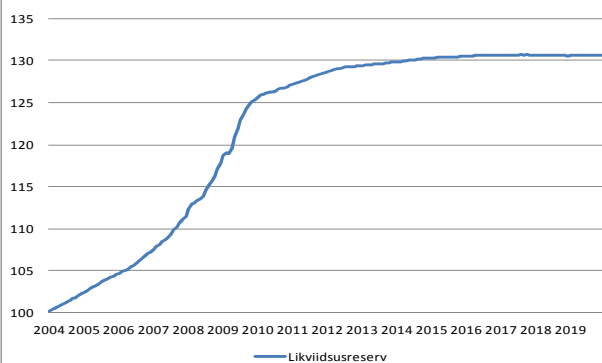
Likviidsusreservi jaotus emitentide lõikes seisuga 31.12.2019



Likviidsusreservi jaotus reitingute lõikes seisuga 31.12.2019



Likviidsusreservi kumulatiivne tulu, tulusus aasta baasil on 1,68%



Likviidsusreservi turuväärtus ja tulusus

