

Aruanne likviidsusreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-märts-2020

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	768 497 498
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-193 221 044
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	445 114 523
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	-193 221 044

1.2. Väärtuse kasv/kahanemine

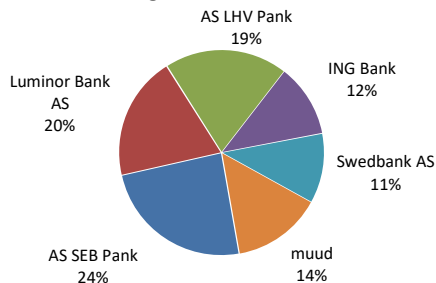
	Portfell	Võrdlusindeks	Erinevus +/-
Tulus 90 päeva (aasta baasil)	-0,96%	-0,46%	-0,50%
Tulus 12 kuud (aasta baasil)	-0,25%	-0,42%	0,17%
Tulus aasta algusest (aasta baasil)	-0,96%	-0,46%	-0,50%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,19		

1.3. Investeeringute koondandmed

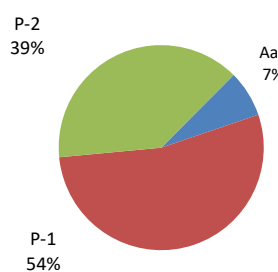
	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
krediidiasutus	100,00%			768 497 498
Investeeringud reitingu alusel				
Aa3	7,28%			55 914 469
P-1	53,70%			412 702 600
P-2	39,02%			299 880 429
Suuremad investeeringud krediidiasutuse/emitendi lõikes				
AS SEB Pank	24,23%	20%	-4,23%	186 229 363
Luminor Bank AS	19,58%	20%	0,42%	150 439 744
AS LHV Pank	19,45%	20%	0,55%	149 440 685
ING Bank	11,51%	20%	8,49%	88 417 680
Swedbank AS	11,03%	20%	8,97%	84 784 143
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	25,71%			197 548 150
hoius	0,00%			0
kontojääk	74,29%			570 949 347
Investeeringud valuuta alusel*				
EUR	100,00%			768 493 468
muud	0,00%	1%	1,00%	4 030

* sh tuletistehingud

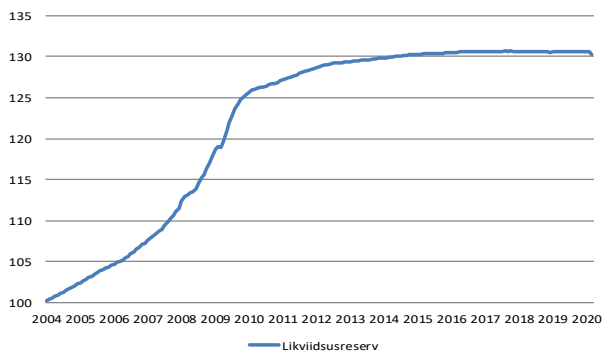
Likviidsusreservi jaotus emitentide lõikes seisuga 31.03.2020



Likviidsusreservi jaotus reitingute lõikes seisuga 31.03.2020



Likviidsusreservi kumulatiivne tulu, tulus aasta baasil on 1,64%



Likviidsusreservi turuväärtus ja tulus

