

# Aruanne likviidsusreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 30-sept-2018

## 1. Üldinfo

### 1.1. Maht

|   | Summa (EUR) |
|---|-------------|
| Reservi maht turuväärtuses:                                 | 872 105 006 |
| Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:        | 146 836 506 |
| Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:       | -3 971 554  |
| Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses: | 128 914 948 |

### 1.2. Väärtuse kasv/kahanemine

|  | Portfell | Võrdlusindeks | Erinevus +/- |
|--|----------|---------------|--------------|
| Tulusus 90 päeva (aasta baasil)                | -0,01%   | -0,36%        | 0,34%        |
| Tulusus 12 kuud (aasta baasil)                 | -0,04%   | -0,36%        | 0,31%        |
| Tulusus aasta algusest (aasta baasil)          | -0,03%   | -0,36%        | 0,33%        |
| Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil) | 0,27     |               |              |

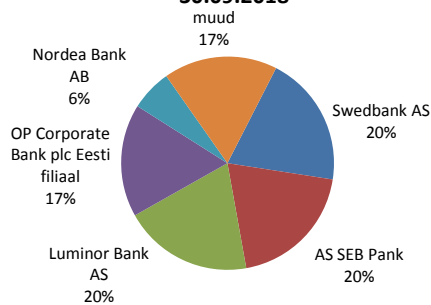
### 1.3. Investeeringute koondandmed

|  | Osakaalud % | Piirnorm | Erinevus +/- | Turuväärtus (EUR) |
|--|-------------|----------|--------------|-------------------|
| <b>Investeeringud sektorite alusel</b>                         |             |          |              |                   |
| valitsus   | 0,95%       |          |              | 8 283 998         |
| krediidiasutus   | 98,72%      |          |              | 860 965 280       |
| supranatsioonaal   | 0,33%       |          |              | 2 855 728         |
| <b>Investeeringud reitingu alusel</b>                          |             |          |              |                   |
| Aaa  | 0,33%       |          |              | 2 855 728         |
| Aa1  | 0,62%       |          |              | 5 446 513         |
| Aa2  | 2,07%       |          |              | 18 094 087        |
| Aa3  | 14,74%      |          |              | 128 553 845       |
| P-1  | 62,58%      |          |              | 545 752 057       |
| P-2  | 19,65%      |          |              | 171 402 777       |
| <b>Suuremad investeeringud krediidiasutuse/emitendi lõikes</b> |             |          |              |                   |
| Swedbank AS  | 19,98%      | 20%      | 0,02%        | 174 213 269       |
| AS SEB Pank  | 19,69%      | 20%      | 0,31%        | 171 719 377       |
| Luminor Bank AS  | 19,65%      | 20%      | 0,35%        | 171 402 777       |
| OP Corporate Bank plc Eesti filiaal                            | 17,14%      | 20%      | 2,86%        | 149 480 364       |
| Nordea Bank AB   | 6,30%       | 20%      | 13,70%       | 54 919 860        |
| <b>Investeeringud instrumentide alusel</b>                     |             |          |              |                   |
| võlakiri   | 23,50%      |          |              | 204 927 748       |
| hoius  | 5,73%       |          |              | 50 000 000        |
| kontojääk  | 70,77%      |          |              | 617 177 258       |
| <b>Investeeringud valuuta alusel*</b>                          |             |          |              |                   |
| EUR  | 100,00%     |          |              | 872 093 299       |
| muud   | 0,00%       | 1%       | 1,00%        | 11 707            |

\* sh tuletistehingud

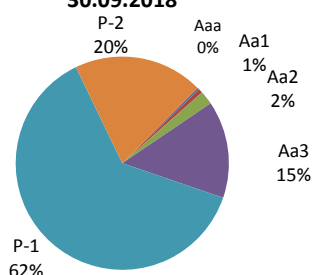
#### Likviidsusreservi jaotus emitentide lõikes seisuga

30.09.2018

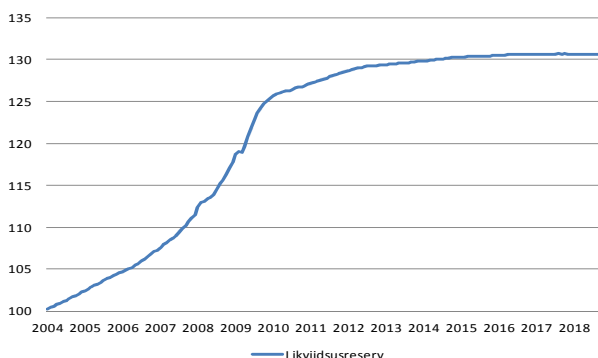


#### Likviidsusreservi jaotus reitingute lõikes seisuga

30.09.2018



#### Likviidsusreservi kumulatiivne tulu, tulusus aasta baasil on 1,83%



#### Likviidsusreservi turuväärtus ja tulusus

