

Aruanne likviidsusreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-dets-2017

1. Üldinfo

1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	743 190 058
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-132 886 502
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-41 715 082
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	-41 715 082

1.2. Väärtuse kasv/kahanemine

	Portfell	Võrdlusindeks	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	-0,07%	-0,35%	0,28%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	-0,01%	-0,35%	0,35%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	-0,01%	-0,35%	0,35%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,26		

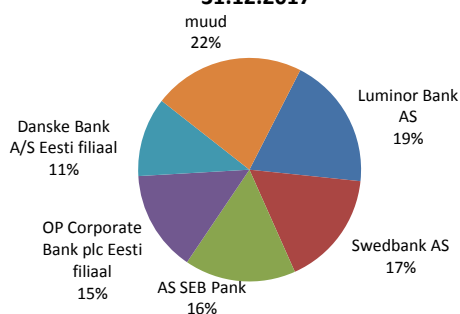
1.3. Investeeringute koondandmed

	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
Investeeringud sektorite alusel				
valitsus	1,12%			8 299 887
krediidiasutus	98,50%			732 029 569
supranatsionaal	0,38%			2 860 603
Investeeringud reitingu alusel				
Aaa	0,38%			2 860 603
Aa1	0,75%			5 565 419
Aa2	2,46%			18 316 848
Aa3	8,47%			62 948 868
P-1	87,93%			653 498 320
Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes				
Luminor Bank AS	19,15%	20%	0,85%	142 293 802
Swedbank AS	16,69%	20%	3,31%	124 046 225
AS SEB Pank	16,13%	20%	3,87%	119 889 767
OP Corporate Bank plc Eesti filiaal	14,63%	20%	5,37%	108 752 750
Danske Bank A/S Eesti filiaal	11,47%	20%	8,53%	85 278 467
Investeeringud instrumentide alusel				
võlakiri	21,92%			162 917 481
hoius	12,11%			90 000 000
kontojääk	65,97%			490 272 577
Investeeringud valuuta alusel*				
EUR	100,00%			743 184 878
muud	0,00%	1%	1,00%	5 180

* sh tuletistehingud

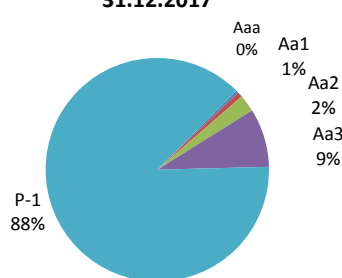
Likviidsusreservi jaotus emitentide lõikes seisuga

31.12.2017

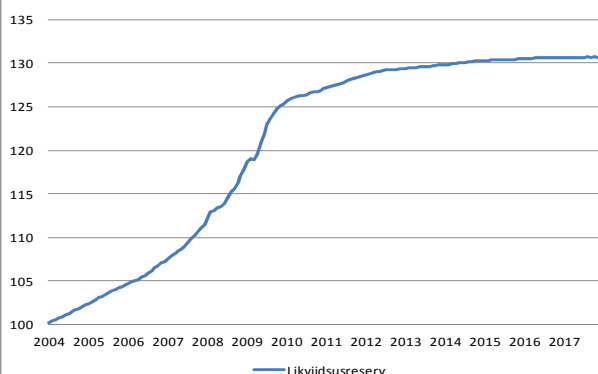


Likviidsusreservi jaotus reitingute lõikes seisuga

31.12.2017



Likviidsusreservi kumulatiivne tulu, tulusus aasta baasil on 1,93%



Likviidsusreservi turuväärtus ja tulusus

