

# Aruanne likviidsusreservi varade koosseisu ja väärtuse kohta

Seisuga: 31-dets-2018

## 1. Üldinfo

### 1.1. Maht

	Summa (EUR)
Reservi maht turuväärtuses:	676 603 019
Reservi mahu muutus 3 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-195 501 987
Reservi mahu muutus 12 kuuga hinnatuna turuväärtuses:	-66 587 040
Reservi mahu muutus aasta algusest hinnatuna turuväärtuses:	-66 587 040

### 1.2. Väärtuse kasv/kahanemine

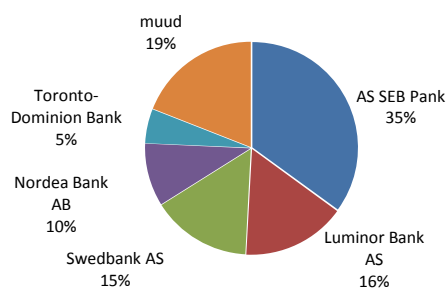
	Portfell	Võrdlusindeks	Erinevus +/-
Tulusus 90 päeva (aasta baasil)	-0,22%	-0,36%	0,14%
Tulusus 12 kuud (aasta baasil)	-0,08%	-0,36%	0,28%
Tulusus aasta algusest (aasta baasil)	-0,08%	-0,36%	0,28%
Investeeringute keskmine kestus (aasta baasil)	0,27		

### 1.3. Investeeringute koondandmed

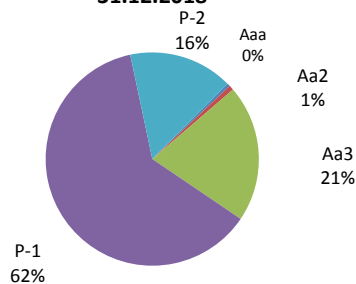
	Osakaalud %	Piirnorm	Erinevus +/-	Turuväärtus (EUR)
<b>Investeeringud sektorite alusel</b>				
valitsus	0,76%			5 129 236
krediidiasutus	98,82%			668 614 269
supranatsionaal	0,42%			2 859 514
<b>Investeeringud reitingu alusel</b>				
Aaa	0,42%			2 859 514
Aa2	0,76%			5 129 236
Aa3	20,79%			140 659 929
P-1	62,19%			420 753 244
P-2	15,84%			107 201 096
<b>Suuremad investeeringud krediitiasutuse/emitendi lõikes</b>				
AS SEB Pank	35,00%	20%	-15,00%	236 821 286
Luminor Bank AS	15,84%	20%	4,16%	107 201 096
Swedbank AS	15,26%	20%	4,74%	103 258 110
Nordea Bank AB	9,61%	20%	10,39%	64 995 810
Toronto-Dominion Bank	5,27%	20%	14,73%	35 631 965
<b>Investeeringud instrumentide alusel</b>				
võlakiri	31,01%			209 819 766
hoius	0,00%			0
kontojääk	68,99%			466 783 252
<b>Investeeringud valuuta alusel*</b>				
EUR	100,00%			676 601 932
muud	0,00%	1%	1,00%	1 087

\* sh tuletistehingud

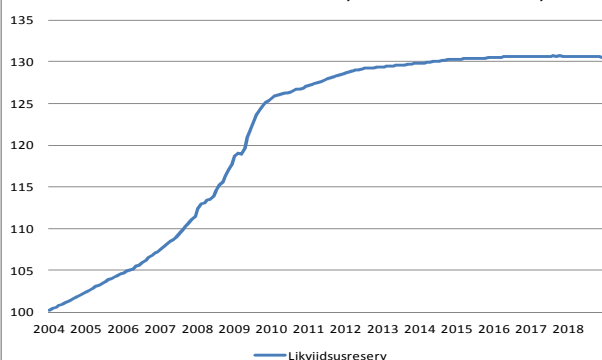
**Likviidsusreservi jaotus emitentide lõikes seisuga 31.12.2018**



**Likviidsusreservi jaotus reitingute lõikes seisuga 31.12.2018**



**Likviidsusreservi kumulatiivne tulu, tulusus aasta baasil on 1,79%**



**Likviidsusreservi turuväärtus ja tulusus**

