

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga 31.05.2020

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

12.06.2020

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.05.2020

Emitent/väärtpaberi nimetus	Reiting	Reitingu-agentuur*	Emitendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Tootlus aegumiseni	Keskmine soetusühikule	Keskmine soetusväärtus kokku	Turuväärtus ühikule	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhastväärtusest	Osakaal fondi varade puhastväärtusest eelneval kuul
1. Väärtpaberid							44 718 826	44 329 018	83.39%	84.71%		
Võlakirjad							44 718 826	44 329 018	83.39%	84.71%		
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	1.45%	1 007.84	100 784	1 046.41	104 641	0.20%	
Luminor 1.5% 18/10/21	Baa2	Moody's	Eesti	XS1894121695	EUR	2.69%	997.09	2 489 729	993.26	2 480 176	4.67%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 684.25	2 416 422	4.55%	
Transpordi Varahaldus 2.85% 18/04/25 ²	NR	-	Eesti	EE3300111160	EUR	2.85%	700.00	2 052 400	702.38	2 059 387	3.87%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	-0.10%	139 180.79	139 181	133 167.12	133 167	0.25%	
Banco Santander 3.875% 06/02/26	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900129	EUR	-0.14%	87 484.59	349 938	124 154.56	496 618	0.93%	
Banco Santander 1.375% 14/12/22	A	Fitch	Hispaania	XS1330948818	EUR	0.42%	105 501.19	527 506	103 036.90	515 185	0.97%	
BMW Finance 2% 04/09/20	A	S&P	Holland	XS0968316256	EUR	0.39%	1 067.33	1 440 889	1 018.98	1 375 629	2.59%	
VW 0.5% 30/03/21	BBB+	Fitch	Holland	XS1586555606	EUR	1.19%	100 700.16	604 201	99 516.93	597 102	1.12%	
Allianz 07/12/20	AA-	Fitch	Holland	DE000A19S4T0	EUR	0.12%	101 250.74	1 518 761	100 060.15	1 500 902	2.82%	
IPIC GMTN 5.875% 14/03/21	AA	Fitch	Kaimanisaared	XS0605559821	EUR	0.32%	1 249.34	999 472	1 056.00	844 804	1.59%	
Qatar 4.5% 20/01/22	AA-	S&P	Katar	XS0615236006	USD	1.29%	1 036.18	620 800	959.17	671 418	1.26%	
Igniis Grupe 2% 21/05/30	BBB+	S&P	Leedu	XS2177349912	EUR	1.83%	986.82	1 578 916	1 015.55	1 624 877	3.06%	
Siauliu Bankas 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.15%	10 000.00	840 000	10 268.85	862 584	1.62%	
Lithuania 3.4% 03/10/20	A	Fitch	Leedu	LT0000607087	EUR	0.09%	0.01	784 574	0.01	724 523	1.36%	
Lithuania 5.5% 17/05/22	A	Fitch	Leedu	LT0000610057	EUR	0.11%	0.01	465 550	0.01	409 440	0.77%	
Lithuania 4.1% 28/02/23	A+	S&P	Leedu	LT0000610065	EUR	0.15%	0.01	454 399	0.01	439 352	0.83%	
Korea Republic 4.25% 07/12/21	AA	S&P	Lõuna-Korea	XS0277265269	EUR	-0.05%	1 215.55	182 332	1 085.70	162 855	0.31%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	1.30%	1 010.36	1 366 011	1 003.03	1 356 093	2.55%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	0.99%	995.56	901 974	1 021.06	925 083	1.74%	
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	0.51%	1 021.62	2 564 271	1 046.48	2 626 667	4.94%	
Latvia 2.625% 21/01/21	A+	S&P	Läti	XS1017763100	EUR	0.13%	1 051.75	631 050	1 025.40	615 237	1.16%	
Latvia 0.375% 27/01/22	A+	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	0.05%	1 004.69	73 342	1 006.66	73 486	0.14%	
PKO Bank 0.75% 25/07/21	A3	Moody's	Poola	XS1650147660	EUR	1.41%	997.96	473 034	998.87	473 466	0.89%	
BNP Paribas 2.875% 24/10/22	AA-	Fitch	Prantsusmaa	XS0847433561	EUR	0.27%	1 090.87	556 342	1 079.48	550 536	1.04%	
Orange 3.875% 14/01/21	Baa1	Moody's	Prantsusmaa	XS0563306314	EUR	0.38%	53 860.24	161 581	51 814.03	155 442	0.29%	
Orange 0.5% 15/01/22	BBB+	Fitch	Prantsusmaa	FR0013396496	EUR	0.23%	100 851.09	302 553	100 615.16	301 845	0.57%	
SANOFI 1.875% 04/09/20	A+	Fitch	Prantsusmaa	FR0011560333	EUR	0.95%	107 461.26	1 611 919	101 392.20	1 520 883	2.86%	
France Government 3.75% 25/04/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0010192997	EUR	-0.47%	1.08	215 960	1.04	208 384	0.39%	
France Government 2.25% 25/10/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011337880	EUR	-0.54%	1.12	39 189	1.08	37 836	0.07%	
Investor 4.5% 12/05/23	Aa3	Moody's	Rootsi	XS0625859516	EUR	0.48%	1 242.74	1 854 169	1 119.87	1 670 850	3.14%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	2.27%	991.64	1 477 549	1 041.97	1 552 531	2.92%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	2.30%	1 043.46	133 563	1 038.65	132 948	0.25%	
German Government 3.25% 04/07/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135440	EUR	-0.54%	0.01	2 147 346	0.01	2 142 382	4.03%	
German Government 2.25% 04/09/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135457	EUR	-0.56%	0.01	737 970	0.01	736 581	1.39%	
Temasek 0.5% 01/03/22	Aaa	Moody's	Singapur	XS1373130902	EUR	0.28%	1 006.82	2 649 957	1 005.10	2 645 414	4.98%	
Fortum 4% 24/05/21	BBB	Fitch	Soome	XS0629937409	EUR	0.43%	1 114.20	1 158 772	1 035.66	1 077 083	2.03%	
Neste Oil 2.125% 17/03/22	NR	-	Soome	FI4000148671	EUR	1.11%	102 468.29	102 468	102 234.64	102 235	0.19%	
Sampo 3.375% 23/05/49	Baa1	Moody's	Soome	XS1995716211	EUR	3.50%	1 005.07	848 278	1 071.73	904 540	1.70%	
China Development Bank 01/06/21	A+	S&P	Šveits	XS1422314689	EUR	0.20%	1 008.47	165 390	1 007.99	165 310	0.31%	
China Development Bank 0.375% 16/11/21	A1	Moody's	Šveits	XS1711173218	EUR	0.21%	1 001.90	1 044 981	1 004.41	1 047 598	1.97%	
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	0.03%	1 008.70	151 305	1 029.30	154 394	0.29%	
Berkshire Hathaway 0.25% 17/01/21	AA	S&P	USA	XS1548792420	EUR	0.15%	1 008.13	806 505	1 001.51	801 210	1.51%	
IBM 1.875% 06/11/20	A2	Moody's	USA	XS0991090175	EUR	0.26%	1 084.93	195 288	1 017.64	183 176	0.34%	
JP Morgan 1.375% 16/09/21	A2	Moody's	USA	XS1110449458	EUR	0.24%	1 031.79	782 098	1 024.38	776 482	1.46%	
JP Morgan Chase And Co 2.75% 24/08/22	A2	Moody's	USA	XS0820547825	EUR	0.45%	1 087.27	450 130	1 072.06	443 834	0.83%	
Bank of America 04/05/23	A2	Moody's	USA	XS1602557495	EUR	0.79%	1 010.05	537 346	991.82	527 648	0.99%	
Bank of America 07/02/22	A2	Moody's	USA	XS1560862580	EUR	0.54%	1 001.56	582 907	999.95	581 968	1.09%	
Morgan Stanley 21/05/21	BBB+	S&P	USA	XS1824289901	EUR	0.18%	993.66	578 312	999.39	581 645	1.09%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.05.2020

Emitent/väärtpaberi nimetus	Reiting	Reitingu-agentuur*	Emitendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Tootlus aegumiseni	Keskmine soetushind ühikule	Keskmine soetusväärtus kokku	Turuväärtus ühikule	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
UPS 15/07/20	A-	S&P	USA	XS1323463056	EUR	0.05%	1 010.60	1 010 596	1 000.46	1 000 458	1.88%	
Wells Fargo And Company 26/04/21	A-	S&P	USA	XS1400169428	EUR	0.30%	1 002.28	544 240	1 000.99	543 539	1.02%	
Wells Fargo And Company 31/01/22	A-	S&P	USA	XS1558022866	EUR	0.59%	994.05	306 167	994.15	306 198	0.58%	
Oodatav krediitkahju (võlakirjad)										- 13 045	- 0.02%	

Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intruss	Algus-kuupäev	Lõpp-tähtaeg	Hoiustatud summa	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoised										8 275 628	15.57%	15.34%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			1 976 211	1 976 211	3.72%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%			14 143	14 143	0.03%	
Tähtajalised hoised												
Coop Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	NR		EUR	0.30%	06.02.2020	04.08.2020	2 602 651	2 602 651	4.90%	
LHV Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa1	Moody's	EUR	0.30%	28.02.2020	28.08.2020	2 189 696	2 189 696	4.12%	
Bigbank	Tähtajaline hoius	Eesti	NR		EUR	0.50%	11.03.2020	10.03.2021	1 518 275	1 518 275	2.86%	
Oodatav krediitkahju (hoised)										- 25 348	- 0.05%	
3. Muud varad										582 000	1.09%	0.00%
Muud nõuded										582 000	1.09%	
VARAD KOKKU										53 186 646	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 26 985	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										53 159 661	100.00%	100.00%

* Lühendatud reitinguagentuuride täisnimed on Moody's Investor Service, Standard&Poors Corporation ja Fitch IBCA.

¹ Investeering, mille väärtus on võrreldes eelneva perioodiga oluliselt (üle 10%) muutunud

² Reguleeritud turul mittetkaubeldavad võlaväärtpaberid

Reguleeritud turul mittetkaubeldavate finantsvarade väärtuse hindamiseks kasutab AS LHV Varahaldus vastavalt veebilehel lhv.ee avalikustatud eeskirjale „LHV Varahalduse investeerimisfondide vara puhasväärtuse määramise eeskiri“ aktiivse turu kõrgeimat ostunoteeringut hindamispäeva seisuga (last bid-price), mis saadakse infotarnija (Bloomberg) vahendusel.