

# LHV Pensionifond S

**Investeeringute aruanne seisuga 28.02.2023**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

14.03.2023

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 28.02.2023

Emitent/väärtpaperi nimetus	Reiting	Reitingu-agentuur*	Emitendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Tootlus aegumiseni	Keskmine soetushind ühikule (EUR)**	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)**	Turväärtus ühikule (EUR)	Turväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
<b>1. Väärtpaberid</b>								<b>29 090 486</b>		<b>28 737 588</b>	<b>96.75%</b>	<b>98.05%</b>
<b>Võlainstrumendid</b>								<b>27 473 647</b>		<b>26 955 401</b>	<b>90.75%</b>	<b>91.96%</b>
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	4.55%	88 854.98	977 405	84 686.12	931 547	3.14%	
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 021.67	715 167	2.41%	
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	5.79%	1 000.00	906 000	953.06	863 468	2.91%	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	5.07%	1 007.84	100 784	995.39	99 539	0.34%	
Kodu Kvartal 8.5% 08/07/2025 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 012.04	303 613	1.02%	
Liven Kodu 10.8% 30/06/2026 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.00%	1 000.00	300 000	1 012.93	303 879	1.02%	
Luminor 0.792% 03/12/24	Baa1	Moody's	Eesti	XS2265801238	EUR	6.56%	1 013.49	1 611 455	947.99	1 507 301	5.07%	
Luminor 7.25% 16/01/2026	Baa1	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	7.24%	1 000.03	650 020	1 009.66	656 280	2.21%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 268.33	2 406 440	8.10%	
Estonia 4.0% 12/10/2032	AA-	S&P	Eesti	XS2532370231	EUR	3.93%	998.15	1 397 416	1 020.24	1 428 340	4.81%	
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL <sup>2</sup>	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002658	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	101 611.11	203 222	0.68%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.67%	139 180.79	139 181	107 407.37	107 407	0.36%	
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	5.74%	900.65	720 520	817.65	654 122	2.20%	
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iirimaa	XS2307764311	EUR	5.17%	694.02	902 220	712.09	925 711	3.12%	
Siauli Bankas 1.047% 07/10/25	Baa2	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	4.94%	1 000.03	600 017	911.13	546 678	1.84%	
Siauli Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.41%	10 000.00	840 000	10 112.89	849 483	2.86%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	3.37%	1 010.36	1 366 011	973.09	1 315 619	4.43%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	3.21%	995.56	901 974	974.77	883 144	2.97%	
Citadele 5% 13/12/2031	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	8.41%	10 000.27	750 020	8 105.77	607 933	2.05%	
Citadele 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	6.27%	996.28	557 914	879.36	492 443	1.66%	
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	4.99%	966.28	821 337	924.82	786 100	2.65%	
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	4.95%	1 000.06	350 020	1 000.82	350 285	1.18%	
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	5.09%	86 925.97	869 260	91 159.67	911 597	3.07%	
France Government 25/03/23	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0013283686	EUR	2.21%	1.00	797 260	1.00	798 784	2.69%	
France Government 1.75% 25/05/2023	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011486067	EUR	2.78%	1.01	505 622	1.01	505 468	1.70%	
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	5.75%	807.20	645 758	826.52	661 212	2.23%	
Eastnine 08/07/24	NR	-	Rootsi	SE0013719788	EUR	8.44%	1 000.01	808 011	999.97	807 975	2.72%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	4.19%	991.64	1 477 549	988.89	1 473 444	4.96%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	4.25%	1 043.46	133 563	971.99	124 415	0.42%	
German Treasury Bill 22/03/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030823	EUR	2.13%	0.01	3 089 782	0.01	3 095 877	10.42%	
German Treasury Bill 23/08/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030872	EUR	2.97%	0.01	493 140	0.01	492 850	1.66%	
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	5.81%	769.77	887 543	754.31	869 715	2.93%	
BP Capital Markets 3.625% PERP	Baa1	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	6.34%	834.48	267 034	900.18	288 057	0.97%	
Oodatav krediitkahju (võlainstrumendid)										- 11 715	- 0.04%	

Emitent/väärtpaperi nimetus	Emitendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Keskmine soetushind ühikule (EUR)**	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)**	Turväärtus ühikule (EUR)	Turväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul	
<b>Aksiad</b>							<b>668</b>	<b>968</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>
VH Agent 003 osa	Eesti	EE3100005430	EUR	1.24	387	1.60	501	0.00%		
VH Agent 004 osa	Eesti	EE3100005455	EUR	0.97	281	1.62	468	0.00%		

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 28.02.2023

Fondi osaku või aktsia nimetus	Fondivalitseja	Fondi päritoluriik	ISIN-kood	Valuuta	Keskmine soetushind ühikule (EUR)**	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)**	Turuväärtus ühikule (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul		
<b>Fondiosakud</b>						<b>1 616 171</b>		<b>1 781 219</b>	<b>6.00%</b>	<b>6.08%</b>		
<b>Kinnisvarafondid</b>						<b>353 771</b>		<b>434 639</b>	<b>1.46%</b>	<b>1.45%</b>		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	353 771	1.23	434 639	1.46%			
<b>Aktsiafondid</b>						<b>1 262 400</b>		<b>1 346 580</b>	<b>4.53%</b>	<b>4.63%</b>		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	509.69	1 262 400	515.73	1 346 580	4.53%			
Krediitiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Lõpp-tähtaeg	Hoiustatud summa (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
<b>2. Hoiused</b>										<b>980 095</b>	<b>3.30%</b>	<b>2.00%</b>
<b>Arvelduskontod</b>												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR				980 095	980 095	3.30%	
<b>VARAD KOKKU</b>									<b>29 717 683</b>	<b>100.05%</b>	<b>100.05%</b>	
Fondi kohustused									- 14 279	- 0.05%	- 0.05%	
<b>FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS</b>									<b>29 703 404</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.00%</b>	

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

\*\* Keskmise soetushinna arvutamisel kasutatakse FIFO meetodit

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

<sup>2</sup> Reguleeritud turul mittekaubeldavad võlaväärtpaberid