

# LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga 31.03.2020

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

14.04.2020

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.03.2020

Emilent/väärtpaperi nimetus	Reiting	Reitingu- agentuur*	Emitendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Tootlus aegumiseni	Keskmine soetusühikule	Keskmine soetusväärtus kokku	Turuväärtus ühikule	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhas- väärtusest	Osakaal fondi varade puhas- väärtusest eelneval kuul
<b>1. Väärtpaberid</b>								<b>47 432 739</b>	<b>46 894 544</b>	<b>86.49%</b>	<b>87.98%</b>	
<b>Võlakirjad</b>								<b>47 432 739</b>	<b>46 894 544</b>	<b>86.49%</b>	<b>87.98%</b>	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	1.53%	1 007.84	100 784	1 041.21	104 121	0.19%	
Luminor 1.5% 18/10/21	Baa2	Moody's	Eesti	XS1894121695	EUR	1.50%	997.09	2 489 729	1 006.76	2 513 885	4.64%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 411.44	2 409 875	4.44%	
Transpordi Varahaldus 2.85% 18/04/25 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300111160	EUR	2.85%	750.00	2 199 000	759.80	2 227 724	4.11%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	0.06%	139 180.79	139 181	136 492.36	136 492	0.25%	
Banco Santander 3.875% 06/02/26	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900129	EUR	0.02%	87 484.59	349 938	123 098.72	492 395	0.91%	
Banco Santander 1.375% 14/12/22	A	Fitch	Hispaania	XS1330948818	EUR	0.61%	105 501.19	527 506	102 455.74	512 279	0.94%	
BMW Finance 2% 04/09/20	A	S&P	Holland	XS0968316256	EUR	0.94%	1 067.33	1 440 889	1 015.92	1 371 493	2.53%	
VW 0.5% 30/03/21	BBB+	Fitch	Holland	XS1586555606	EUR	1.49%	100 700.16	604 201	99 033.37	594 200	1.10%	
Allianz 07/12/20	AA-	Fitch	Holland	DE000A195470	EUR	0.66%	101 250.74	1 518 761	99 573.89	1 493 608	2.75%	
Vonovia Finance 22/12/22	BBB+	S&P	Holland	DE000A19X793	EUR	0.80%	99 968.66	299 906	97 999.43	293 998	0.54%	
Daimler Int'l Finance 0 11/05/2022	BBB+	S&P	Holland	DE000A19HBM3	EUR	0.94%	100 601.33	1 509 020	98 010.00	1 470 150	2.71%	
DT 03/04/20	BBB+	Fitch	Holland	XS1382791892	EUR	2.40%	1 006.04	905 438	999.84	899 856	1.66%	
IPIC GMTN 5.875% 14/03/21	AA	Fitch	Kaimanisaared	XS0605559821	EUR	2.43%	1 249.34	999 472	1 034.71	827 765	1.53%	
Qatar 4.5% 20/01/22	AA-	S&P	Katar	XS0615236006	USD	2.87%	1 053.20	620 800	946.62	662 636	1.22%	
Siaulių Bankas 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 166.35	853 974	1.58%	
Lithuania 3.4% 03/10/20	A	Fitch	Leedu	LT0000607087	EUR	0.07%	0.01	784 574	0.01	724 469	1.34%	
Lithuania 5.5% 17/05/22	A	Fitch	Leedu	LT0000610057	EUR	0.08%	0.01	465 550	0.01	429 958	0.79%	
Lithuania 4.1% 28/02/23	A+	S&P	Leedu	LT0000610065	EUR	0.14%	0.01	454 399	0.01	439 416	0.81%	
Korea Republic 4.25% 07/12/21	AA	S&P	Lõuna-Korea	XS0277265269	EUR	-0.23%	1 215.55	182 332	1 089.03	163 355	0.30%	
ALTUM G 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	1.09%	1 010.36	1 366 011	1 010.85	1 366 676	2.52%	
ALTUM G 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	1.07%	995.56	901 974	1 015.90	920 402	1.70%	
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	0.75%	1 021.62	2 564 271	1 040.31	2 611 189	4.82%	
Latvia 2.625% 21/01/21	A+	S&P	Läti	XS1017763100	EUR	0.39%	1 051.75	631 050	1 023.02	613 812	1.13%	
Latvia 0.375% 27/01/22	A+	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	0.05%	1 004.69	73 342	1 006.58	73 481	0.14%	
PKO Bank 0.75% 25/07/21	A3	Moody's	Poola	XS1650147660	EUR	1.52%	997.96	473 034	995.12	471 688	0.87%	
BNP Paribas 2.875% 24/10/22	AA-	Fitch	Prantsusmaa	XS0847433561	EUR	1.09%	1 090.87	556 342	1 057.46	539 304	0.99%	
Orange 3.875% 14/01/21	Baa1	Moody's	Prantsusmaa	XS0563306314	EUR	0.60%	53 860.24	161 581	51 690.12	155 070	0.29%	
Orange 0.5% 15/01/22	BBB+	Fitch	Prantsusmaa	FR0013396496	EUR	0.71%	100 851.09	302 553	99 736.83	299 210	0.55%	
SANOFI 1.875% 04/09/20	A+	Fitch	Prantsusmaa	FR0011560333	EUR	1.37%	107 461.26	1 611 919	101 280.70	1 519 210	2.80%	
France Government 2.25% 25/10/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011337880	EUR	-0.57%	1.12	39 189	1.08	37 901	0.07%	
GECINA 30/06/22	A-	S&P	Prantsusmaa	FR0013266343	EUR	0.29%	100 009.25	600 055	99 359.00	596 154	1.10%	
Investor 4.5% 12/05/23	Aa3	Moody's	Rootsi	XS0625859516	EUR	0.75%	1 242.74	1 854 169	1 154.82	1 722 986	3.18%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	2.21%	991.64	1 477 549	1 040.87	1 550 890	2.86%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	2.01%	1 043.46	133 563	1 050.20	134 426	0.25%	
German Government 3.25% 04/07/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135440	EUR	-0.61%	0.01	1 181 368	0.01	1 180 327	2.18%	
German Government 2.25% 04/09/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135457	EUR	-0.60%	0.01	1 160 586	0.01	1 159 255	2.14%	
SAP 01/04/20	A2	Moody's	Saksamaa	DE000A14KJE8	EUR	0.00%	1 008.12	1 008 120	1 000.00	1 000 000	1.84%	
Temasek 0.5% 01/03/22	Aaa	Moody's	Singapur	XS1373130902	EUR	0.21%	1 006.82	2 649 957	1 005.97	2 647 716	4.88%	
Fortum 4% 24/05/21	BBB	Fitch	Soome	XS0629937409	EUR	0.53%	1 114.20	1 158 772	1 073.66	1 116 605	2.06%	
Neste Oil 2.125% 17/03/22	NR	-	Soome	FI4000148671	EUR	1.34%	102 468.29	102 468	101 586.51	101 587	0.19%	
Sampo 3.375% 23/05/49 <sup>1</sup>	Baa1	Moody's	Soome	XS1995716211	EUR	4.02%	1 005.07	848 278	1 019.24	860 241	1.59%	
China Development Bank 01/06/21	A+	S&P	Šveits	XS1422314689	EUR	-0.02%	1 008.47	165 390	1 010.26	165 683	0.31%	
China Development Bank 0.375% 16/11/21	A1	Moody's	Šveits	XS1711173218	EUR	0.36%	1 001.90	1 044 981	1 001.69	1 044 766	1.93%	

LHV Pensionifond S investeerinaute aruanne seisua 31.03.2020

Emitent/väärtpaber nimetus	Reiting	Reitinguagentuur*	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
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	0.52%	1 008.70	151 305	1 016.13	152 419	0.28%	
Berkshire Hathaway 0.25% 17/01/21	AA	S&P	USA	XS1548792420	EUR	0.56%	1 008.13	806 505	998.04	798 428	1.47%	
IBM 1.875% 06/11/20	A2	Moody's	USA	XS0991090175	EUR	0.52%	1 084.93	195 288	1 015.61	182 810	0.34%	
JP Morgan 1.375% 16/09/21	A2	Moody's	USA	XS1110449458	EUR	1.62%	1 031.79	782 098	1 003.78	760 866	1.40%	
JP Morgan Chase And Co 2.75% 24/08/22	A2	Moody's	USA	XS0820547825	EUR	1.44%	1 087.27	450 130	1 047.13	433 512	0.80%	
Bank of America 04/05/23	A2	Moody's	USA	XS1602557495	EUR	2.15%	1 010.05	537 346	947.99	504 332	0.93%	
Bank of America 07/02/22	A2	Moody's	USA	XS1560862580	EUR	1.85%	1 001.56	582 907	974.80	567 333	1.05%	
Goldman Sachs 29/05/20	BBB+	S&P	USA	XS1240146891	EUR	1.13%	1 001.74	583 010	998.80	581 299	1.07%	
Morgan Stanley 21/05/21	BBB+	S&P	USA	XS1824289901	EUR	1.71%	993.66	578 312	980.69	570 762	1.05%	
UPS 15/07/20	A2	Moody's	USA	XS1323463056	EUR	0.09%	1 010.60	1 010 596	1 000.08	1 000 077	1.84%	
Wells Fargo And Company 26/04/21	A-	S&P	USA	XS1400169428	EUR	1.59%	1 002.28	544 240	986.19	535 499	0.99%	
Wells Fargo And Company 31/01/22	A-	S&P	USA	XS1558022866	EUR	2.12%	994.05	306 167	964.22	296 979	0.55%	

Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Lõpp-tähtaeg	Hoiustatud summa	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
<b>2. Hoised</b>										<b>7 350 728</b>	<b>13.56%</b>	<b>12.07%</b>
<b>Arvelduskontod</b>												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			1 047 301	1 047 301	1.93%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%			14 376	14 376	0.03%	
<b>Tähtajalised hoised</b>												
Coop Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	NR		EUR	0.30%	06.02.2020	04.08.2020	2 601 350	2 601 350	4.80%	
LHV	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa1	Moody's	EUR	0.30%	28.02.2020	28.08.2020	2 188 583	2 188 583	4.04%	
Bigbank	Tähtajaline hoius	Eesti	NR		EUR	0.50%	11.03.2020	10.03.2021	1 517 012	1 517 012	2.80%	
Oodatav krediidikahju (hoised)										- 17 894	- 0.03%	
<b>VARAD KOKKU</b>										<b>54 245 272</b>	<b>100.05%</b>	<b>100.05%</b>
<b>Fondi kohustused</b>										<b>- 27 679</b>	<b>- 0.05%</b>	<b>- 0.05%</b>
<b>FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS</b>										<b>54 217 594</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.00%</b>

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

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

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

Reguleeritud turul mittekaubeldavate 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.