

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **31.08.2020**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

11.09.2020

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.08.2020

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
1. Väärtpaberid								46 070 053	46 062 251	84.99%	86.59%	
Võlakirjad								46 070 053	46 062 251	84.99%	86.59%	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	0.94%	1 007.84	100 784	1 065.79	106 579	0.20%	
Luminor 1.5% 18/10/21	Baa2	Moody's	Eesti	XS1894121695	EUR	1.19%	997.09	2 489 729	1 016.53	2 538 282	4.68%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 277.28	2 406 655	4.44%	
Transpordi Varahaldus 2.85% 18/04/25 ²	NR	-	Eesti	EE3300111160	EUR	2.85%	700.00	2 052 400	707.48	2 074 335	3.83%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	-0.21%	139 180.79	139 181	134 025.88	134 026	0.25%	
Banco Santander 3.875% 06/02/26	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900129	EUR	-0.26%	87 484.59	349 938	124 832.60	499 330	0.92%	
Banco Santander 1.375% 14/12/22	A	Fitch	Hispaania	XS1330948818	EUR	-0.11%	105 501.19	527 506	104 383.53	521 918	0.96%	
BMW Finance 2% 04/09/20	A	S&P	Holland	XS0968316256	EUR	2.86%	1 067.33	1 440 889	1 019.64	1 376 516	2.54%	
VW 0.5% 30/03/21	BBB+	Fitch	Holland	XS1586555606	EUR	0.02%	100 700.16	604 201	100 491.96	602 952	1.11%	
Allianz 07/12/20	AA-	Fitch	Holland	DE000A19S4T0	EUR	-0.44%	101 250.74	1 518 761	100 162.53	1 502 438	2.77%	
IPIC GMTN 5.875% 14/03/21	AA	Fitch	Kaimanisaared	XS0605559821	EUR	0.16%	1 249.34	999 472	1 057.81	846 250	1.56%	
Qatar 4.5% 20/01/22	AA-	S&P	Katar	XS0615236006	USD	0.69%	966.41	620 800	885.69	619 981	1.14%	
Ignitis Grupe 2% 21/05/30	BBB+	S&P	Leedu	XS2177349912	EUR	1.54%	986.82	1 578 916	1 046.59	1 674 542	3.09%	
Siauliu Bankas 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 423.44	875 569	1.62%	
Lithuania 3.4% 03/10/20	A	Fitch	Leedu	LT0000607087	EUR	-0.04%	0.01	784 574	0.01	724 709	1.34%	
Korea Republic 4.25% 07/12/21	AA	S&P	Lõuna-Korea	XS0277265269	EUR	-0.09%	1 215.55	182 332	1 086.25	162 938	0.30%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	1.30%	1 010.36	1 366 011	1 006.29	1 360 510	2.51%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	0.90%	995.56	901 974	1 027.33	930 762	1.72%	
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	0.43%	1 021.62	2 564 271	1 030.27	2 585 974	4.77%	
Latvia 2.625% 21/01/21	A+	S&P	Läti	XS1017763100	EUR	-0.43%	1 051.75	631 050	1 027.99	616 796	1.14%	
Latvia 0.375% 27/01/22	A+	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	-0.07%	1 004.69	73 342	1 008.48	73 619	0.14%	
PKO Bank 0.75% 25/07/21	A3	Moody's	Poola	XS1650147660	EUR	0.74%	997.96	473 034	1 000.81	474 384	0.88%	
BNP Paribas 2.875% 24/10/22	AA-	Fitch	Prantsusmaa	XS0847433561	EUR	-0.11%	1 090.87	556 342	1 088.77	555 272	1.02%	
Orange 3.875% 14/01/21	Baa1	Moody's	Prantsusmaa	XS0563306314	EUR	-0.16%	53 860.24	161 581	51 969.55	155 909	0.29%	
Orange 0.5% 15/01/22	BBB+	Fitch	Prantsusmaa	FR0013396496	EUR	-0.15%	100 851.09	302 553	101 200.84	303 603	0.56%	
France Government 3.75% 25/04/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0010192997	EUR	-0.54%	1.05	1 988 072	1.04	1 978 148	3.65%	
France Government 25/05/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0013157096	EUR	-0.57%	1.01	1 809 422	1.00	1 807 632	3.34%	
France Government 2.25% 25/10/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011337880	EUR	-0.58%	1.12	39 189	1.08	37 822	0.07%	
Investor 4.5% 12/05/23	Aa3	Moody's	Rootsi	XS0625859516	EUR	-0.02%	1 242.74	1 854 169	1 135.71	1 694 487	3.13%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	1.02%	991.64	1 477 549	1 099.19	1 637 799	3.02%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	1.20%	1 043.46	133 563	1 100.22	140 828	0.26%	
German Treasury Bill 14/04/2021	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001030203	EUR	-0.54%	0.01	803 506	0.01	802 712	1.48%	
German Government 3.25% 04/07/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135440	EUR	-0.58%	0.01	1 603 197	0.01	1 556 362	2.87%	
German Government 2.25% 04/09/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135457	EUR	-0.63%	0.01	1 790 769	0.01	1 787 693	3.30%	
Temasek 0.5% 01/03/22	Aaa	Moody's	Singapur	XS1373130902	EUR	0.22%	1 006.82	2 649 957	1 006.73	2 649 705	4.89%	
Fortum 4% 24/05/21	BBB	Fitch	Soome	XS0629937409	EUR	-0.07%	1 114.20	1 158 772	1 040.56	1 082 182	2.00%	
Neste Oil 2.125% 17/03/22	NR	-	Soome	FI4000148671	EUR	0.58%	102 468.29	102 468	103 335.26	103 335	0.19%	
Sampo 3.375% 23/05/19	Baa1	Moody's	Soome	XS1995716211	EUR	3.39%	1 005.07	848 278	1 115.05	941 099	1.74%	
China Development Bank 01/06/21	A+	S&P	Šveits	XS1422314689	EUR	-0.01%	1 008.47	165 390	1 005.02	164 823	0.30%	
China Development Bank 0.375% 16/11/21	A1	Moody's	Šveits	XS1711173218	EUR	0.05%	1 001.90	1 044 981	1 006.86	1 050 156	1.94%	
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	-0.23%	1 008.70	151 305	1 035.14	155 271	0.29%	
Berkshire Hathaway 0.25% 17/01/21	AA	S&P	USA	XS1548792420	EUR	0.01%	1 008.13	806 505	1 002.48	801 984	1.48%	
IBM 1.875% 06/11/20	A2	Moody's	USA	XS0991090175	EUR	-0.04%	1 084.93	195 288	1 018.86	183 394	0.34%	
JP Morgan 1.375% 16/09/21	A2	Moody's	USA	XS1110449458	EUR	-0.32%	1 031.79	782 098	1 030.86	781 391	1.44%	
JP Morgan Chase And Co 2.75% 24/08/22	A2	Moody's	USA	XS0820547825	EUR	-0.09%	1 087.27	450 130	1 056.95	437 576	0.81%	
Bank of America 04/05/23	A2	Moody's	USA	XS1602557495	EUR	0.15%	1 010.05	537 346	1 004.54	534 414	0.99%	
Bank of America 07/02/22	A2	Moody's	USA	XS1560862580	EUR	0.16%	1 001.56	582 907	1 002.66	583 549	1.08%	
Morgan Stanley 21/05/21	BBB+	S&P	USA	XS1824289901	EUR	-0.35%	993.66	578 312	1 002.57	583 496	1.08%	
Wells Fargo And Company 26/04/21	BBB+	S&P	USA	XS1400169428	EUR	-0.27%	1 002.28	544 240	1 003.00	544 630	1.00%	
Wells Fargo And Company 31/01/22	BBB+	S&P	USA	XS1558022866	EUR	-0.17%	994.05	306 167	1 002.83	308 870	0.57%	
Oodatav krediitkahju (võlakirjad)										- 10 955	- 0.02%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.08.2020

Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Löpp-tähtaeg	Hoiustatud summa	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoiused										8 162 392	15.06%	13.46%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			1 816 469	1 816 469	3.35%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%			26 382	26 382	0.05%	
Tähtajalised hoiused												
LHV Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa1	Moody's	EUR	0.10%	31.08.2020	01.03.2021	2 200 000	2 200 000	4.06%	
Bigbank	Tähtajaline hoius	Eesti	NR		EUR	0.50%	11.03.2020	10.03.2021	1 520 206	1 520 206	2.80%	
Coop Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa2	Moody's	EUR	0.55%	04.08.2020	02.08.2021	2 605 072	2 605 072	4.81%	
Oodatav krediidikahju (hoiused)										- 5 736	- 0.01%	
3. Muud varad										0	0.00%	0.00%
VARAD KOKKU										54 224 643	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 27 453	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										54 197 190	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 mittekaubeldavad võlaväärtpaberid

Reguleeritud turul mittekaubeldavate väärtpaperite ja kinniste ning mitteavalike fondide väärtus on leitud vastavalt Aktsiaselts LHV Varahaldus sise-eeskirjas "LHV Varahalduse investeerimisfondide vara puhasväärtuse määramise eeskiri" toodud põhimõtetele ning ei pruugi aruandeperioodi lõpu seisuga kajastada kõigi instrumentide puhul COVID-19 mõju instrumentide väärtusele. Aktsiaselts LHV Varahaldus hindab jooksvalt COVID-19 potentsiaalset mõju fondi investeringutele ning täiendava info teatavaks saamisel teostab nõuetekohased ümberhindlused.