

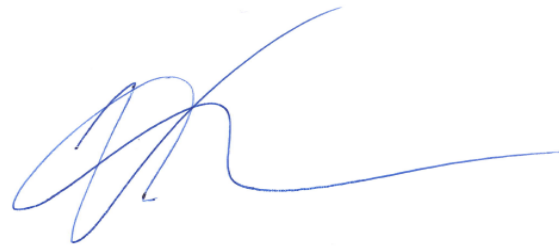
LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **30.09.2020**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

14.10.2020

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 30.09.2020

Emitent/väärtpaberid 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							45 487 108	45 570 363			86.26%	84.99%
Võlainstrumendid							45 487 108	45 570 363			86.26%	84.99%
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	0.86%	1 007.84	100 784	1 045.05	104 505	0.20%	
Luminor 1.5% 18/10/21	Baa2	Moody's	Eesti	XS1894121695	EUR	0.89%	997.09	2 489 729	1 020.51	2 548 219	4.82%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 411.44	2 409 875	4.56%	
Transpordi Varahaldus 2.85% 18/04/25 ²	NR	-	Eesti	EE3300111160	EUR	2.85%	700.00	2 052 400	709.14	2 079 209	3.94%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	-0.30%	139 180.79	139 181	134 747.01	134 747	0.26%	
Banco Santander 3.875% 06/02/26	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900129	EUR	-0.35%	87 484.59	349 938	125 350.22	501 401	0.95%	
Banco Santander 1.375% 14/12/22	A	Fitch	Hispaania	XS1330948818	EUR	-0.14%	105 501.19	527 506	104 432.24	522 161	0.99%	
VW 0.5% 30/03/21	BBB+	Fitch	Holland	XS1586555606	EUR	-0.04%	100 700.16	604 201	100 524.06	603 144	1.14%	
Allianz 07/12/20	AA-	Fitch	Holland	DE000A19S4T0	EUR	-0.51%	101 250.74	1 518 761	100 097.28	1 501 459	2.84%	
IPIC GMTN 5.875% 14/03/21	AA	Fitch	Kaimanisaaed	XS0605559821	EUR	-0.11%	1 249.34	999 472	1 059.28	847 425	1.60%	
Qatar 4.5% 20/01/22	AA-	S&P	Katar	XS0615236006	USD	1.05%	985.56	620 800	899.71	629 797	1.19%	
Ignitis Grupe 2% 21/05/30	BBB+	S&P	Leedu	XS2177349912	EUR	1.44%	986.82	1 578 916	1 057.23	1 691 573	3.20%	
Siauliu Bankas 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.15%	10 000.00	840 000	10 473.85	879 804	1.67%	
Lithuania 3.4% 03/10/20	A	Fitch	Leedu	LT0000607087	EUR	-0.25%	0.01	784 574	0.01	724 710	1.37%	
Korea Republic 4.25% 07/12/21	AA	S&P	Lõuna-Korea	XS0277265269	EUR	-0.13%	1 215.55	182 332	1 086.62	162 994	0.31%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	1.30%	1 010.36	1 366 011	1 007.36	1 361 954	2.58%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	0.85%	995.56	901 974	1 030.40	933 539	1.77%	
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	0.36%	1 021.62	2 564 271	1 031.83	2 589 894	4.90%	
Latvia 2.625% 21/01/21	A+	S&P	Läti	XS1017763100	EUR	-0.60%	1 051.75	631 050	1 028.15	616 887	1.17%	
Latvia 0.375% 27/01/22	A+	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	-0.07%	1 004.69	73 342	1 008.43	73 615	0.14%	
PKO Bank 0.75% 25/07/21	A3	Moody's	Poola	XS1650147660	EUR	0.74%	997.96	473 034	1 001.47	474 695	0.90%	
BNP Paribas 2.875% 24/10/22	AA-	Fitch	Prantsusmaa	XS0847433561	EUR	-0.15%	1 090.87	556 342	1 089.54	555 668	1.05%	
Orange 3.875% 14/01/21	Baa1	Moody's	Prantsusmaa	XS0563306314	EUR	-0.13%	53 860.24	161 581	51 954.87	155 865	0.30%	
Orange 0.5% 15/01/22	BBB+	Fitch	Prantsusmaa	FR0013396496	EUR	-0.13%	100 851.09	302 553	101 166.83	303 500	0.57%	
France Government 3.25% 25/10/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011059088	EUR	-0.60%	1.07	857 944	1.07	857 312	1.62%	
France Government 3.75% 25/04/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0010192997	EUR	-0.55%	1.05	1 988 072	1.04	1 977 411	3.74%	
France Government 25/05/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0013157096	EUR	-0.60%	1.01	1 809 422	1.00	1 807 074	3.42%	
France Government 2.25% 25/10/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011337880	EUR	-0.62%	1.12	39 189	1.08	37 834	0.07%	
Investor 4.5% 12/05/23	Aa3	Moody's	Rootsi	XS0625859516	EUR	-0.15%	1 242.74	1 854 169	1 139.15	1 699 617	3.22%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	0.84%	991.64	1 477 549	1 107.55	1 650 250	3.12%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	0.99%	1 043.46	133 563	1 111.94	142 328	0.27%	
German Treasury Bill 14/04/2021	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001030203	EUR	-0.59%	0.01	803 506	0.01	802 560	1.52%	
German Government 3.25% 04/07/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135440	EUR	-0.54%	0.01	1 603 197	0.01	1 555 163	2.94%	
German Government 2.25% 04/09/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135457	EUR	-0.57%	0.01	1 790 769	0.01	1 747 452	3.31%	
Temasek 0.5% 01/03/22	Aaa	Moody's	Singapur	XS1373130902	EUR	0.20%	1 006.82	2 649 957	1 007.07	2 650 602	5.02%	
Fortum 4% 24/05/21	BBB	Fitch	Soome	XS0629937409	EUR	-0.12%	1 114.20	1 158 772	1 040.85	1 082 481	2.05%	
Neste 2.125% 17/03/22	NR	-	Soome	FI4000148671	EUR	0.56%	102 468.29	102 468	103 414.92	103 415	0.20%	
Sampo 3.375% 23/05/49	Baa1	Moody's	Soome	XS1995716211	EUR	3.34%	1 005.07	848 278	1 114.86	940 942	1.78%	
China Development Bank 01/06/21	A+	S&P	Šveits	XS1422314689	EUR	-0.04%	1 008.47	165 390	1 005.30	164 869	0.31%	
China Development Bank 0.375% 16/11/21	A1	Moody's	Šveits	XS1711173218	EUR	0.06%	1 001.90	1 044 981	1 006.90	1 050 195	1.99%	
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	-0.25%	1 008.70	151 305	1 035.40	155 310	0.29%	
Berkshire Hathaway 0.25% 17/01/21	AA	S&P	USA	XS1548792420	EUR	0.01%	1 008.13	806 505	1 002.42	801 932	1.52%	
IBM 1.875% 06/11/20	A2	Moody's	USA	XS0991090175	EUR	0.00%	1 084.93	195 288	1 018.74	183 374	0.35%	
JP Morgan 1.375% 16/09/21	A2	Moody's	USA	XS1110449458	EUR	-0.38%	1 031.79	782 098	1 017.42	771 202	1.46%	
JP Morgan Chase And Co 2.75% 24/08/22	A2	Moody's	USA	XS0820547825	EUR	-0.09%	1 087.27	450 130	1 056.65	437 452	0.83%	
Bank of America 04/05/23	A2	Moody's	USA	XS1602557495	EUR	0.06%	1 010.05	537 346	1 006.50	535 459	1.01%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 30.09.2020

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
Bank of America 07/02/22	A2	Moody's	USA	XS1560862580	EUR	0.16%	1 001.56	582 907	1 002.61	583 519	1.10%	
Morgan Stanley 21/05/21	BBB+	S&P	USA	XS1824289901	EUR	-0.38%	993.66	578 312	1 002.50	583 455	1.10%	
Wells Fargo And Company 26/04/21	BBB+	S&P	USA	XS1400169428	EUR	-0.31%	1 002.28	544 240	1 002.94	544 597	1.03%	
Wells Fargo And Company 31/01/22	BBB+	S&P	USA	XS1558022866	EUR	-0.20%	994.05	306 167	1 002.82	308 869	0.58%	
Oodatav krediitkahju (võlainstrumentid)										- 10 955	- 0.02%	

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. Hoised										7 287 290	13.79%	15.06%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			961 087	961 087	1.82%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%			26 905	26 905	0.05%	
Tähtajalised hoised												
LHV Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa1	Moody's	EUR	0.10%	31.08.2020	01.03.2021	2 200 183	2 200 183	4.16%	
Bigbank	Tähtajaline hoius	Eesti	NR		EUR	0.50%	11.03.2020	10.03.2021	1 520 829	1 520 829	2.88%	
Coop Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa2	Moody's	EUR	0.55%	04.08.2020	02.08.2021	2 606 265	2 606 265	4.93%	
Oodatav krediitkahju (hoised)										- 27 979	- 0.05%	
VARAD KOKKU										52 857 653	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 25 975	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										52 831 678	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 mittekabeldavad võlaväärtpaberid

Reguleeritud turul mittekabeldavate väärtpaberite 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.