

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga 31.12.2020

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

13.01.2021

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.12.2020

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 puhast väärtusest	Osakaal fondi varade puhast väärtusest eelneval kuul	
1. Väärtpaberid							45 481 901	45 680 614	85.51%	84.52%			
Võlainstrumendid							45 481 901	45 680 614	85.51%	84.52%			
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	0.34%	1 007.84	100 784	1 061.92	106 192	0.20%		
Luminor 0.792% 03/11/24	Baa2	Moody's	Eesti	XS2265801238	EUR	0.63%	1 000.02	1 100 020	1 007.61	1 108 368	2.07%		
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 004.47	2 400 107	4.49%		
Transpordi Varahaldus 2.85% 18/04/25 ²	NR	-	Eesti	EE3300111160	EUR	2.85%	650.00	1 905 800	653.81	1 916 965	3.59%		
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	-0.36%	139 180.79	139 181	135 098.77	135 099	0.25%		
Banco Santander 3.875% 06/02/26	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900129	EUR	-0.40%	87 484.59	349 938	125 578.27	502 313	0.94%		
Banco Santander 1.375% 14/12/22	A	Fitch	Hispaania	XS1330948818	EUR	-0.29%	105 501.19	527 506	103 337.04	516 685	0.97%		
VW 0.5% 30/03/21	BBB+	Fitch	Holland	XS1586555606	EUR	-1.13%	100 700.16	604 201	100 776.08	604 656	1.13%		
IPIC GMTN 5.875% 14/03/21	AA	Fitch	Kaimanisaared	XS0605559821	EUR	-0.40%	1 249.34	999 472	1 059.59	847 672	1.59%		
Qatar 4.5% 20/01/22	AA-	S&P	Katar	XS0615236006	USD	0.48%	940.34	620 800	865.66	605 961	1.13%		
Igniis Grupe 2% 21/05/30	BBB+	S&P	Leedu	XS2177349912	EUR	0.86%	986.82	1 578 916	1 114.27	1 782 838	3.34%		
Siauli Bankas 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.15%	10 000.00	840 000	10 013.48	841 132	1.57%		
Korea Republic 4.25% 07/12/21	AA	S&P	Lõuna-Korea	XS0277265269	EUR	-0.46%	1 215.55	182 332	1 047.02	157 054	0.29%		
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	0.70%	1 010.36	1 366 011	1 035.18	1 399 562	2.62%		
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	0.67%	995.56	901 974	1 026.17	929 711	1.74%		
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	-0.04%	1 021.62	2 564 271	1 038.62	2 606 934	4.88%		
Latvia 2.625% 21/01/21	A+	S&P	Läti	XS1017763100	EUR	-0.84%	1 051.75	631 050	1 026.74	616 046	1.15%		
Latvia 0.375% 27/01/22	A+	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	-0.25%	1 004.69	73 342	1 010.14	73 740	0.14%		
PKO Bank 0.75% 25/07/21	A3	Moody's	Poola	XS1650147660	EUR	0.08%	997.96	473 034	1 007.02	477 326	0.89%		
BNP Paribas 2.875% 24/10/22	AA-	Fitch	Prantsusmaa	XS0847433561	EUR	-0.33%	1 090.87	556 342	1 063.78	542 526	1.02%		
Orange 3.875% 14/01/21	Baa1	Moody's	Prantsusmaa	XS0563306314	EUR	0.71%	53 860.24	161 581	51 921.89	155 766	0.29%		
Orange 0.5% 15/01/22	BBB+	Fitch	Prantsusmaa	FR0013396496	EUR	-0.26%	100 851.09	302 553	101 271.51	303 815	0.57%		
France Government 3.25% 25/10/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011059088	EUR	-0.63%	1.05	2 148 013	1.04	2 127 666	3.98%		
France Government 3.75% 25/04/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0010192997	EUR	-0.67%	1.05	1 988 072	1.04	1 975 306	3.70%		
France Government 25/05/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0013157096	EUR	-0.68%	1.01	1 809 422	1.00	1 804 824	3.38%		
France Government 2.25% 25/10/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011337880	EUR	-0.72%	1.06	1 205 083	1.06	1 201 511	2.25%		
Investor 4.5% 12/05/23	Aa3	Moody's	Rootsi	XS0625859516	EUR	-0.34%	1 242.74	1 854 169	1 143.70	1 706 394	3.19%		
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	0.30%	991.64	1 477 549	1 102.79	1 643 159	3.08%		
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	0.57%	1 043.46	133 563	1 108.02	141 826	0.27%		
German Treasury Bill 14/04/2021	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001030203	EUR	-0.74%	0.01	803 506	0.01	801 673	1.50%		
German Government 3.25% 04/07/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135440	EUR	-0.65%	0.01	2 164 794	0.01	2 123 549	3.98%		
German Government 2.25% 04/09/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135457	EUR	-0.67%	0.01	1 790 769	0.01	1 746 196	3.27%		
Temasek 0.5% 01/03/22	Aaa	Moody's	Singapur	XS1373130902	EUR	-0.05%	1 006.82	2 649 957	1 010.58	2 659 842	4.98%		
Fortum 2.25% 06/09/22	BBB	Fitch	Soome	XS0825855751	EUR	-0.15%	1 049.15	462 675	1 047.58	461 983	0.86%		
Fortum 4% 24/05/21	BBB	Fitch	Soome	XS0629937409	EUR	-0.20%	1 102.46	1 367 051	1 040.84	1 290 641	2.42%		
Neste 2.125% 17/03/22	NR	-	Soome	FI4000148671	EUR	0.50%	102 468.29	102 468	103 627.53	103 628	0.19%		
Sampo 3.375% 23/05/49	Baa1	Moody's	Soome	XS1995716211	EUR	3.11%	1 039.76	1 189 489	1 169.30	1 337 676	2.50%		
China Development Bank 01/06/21	A+	S&P	Šveits	XS1422314689	EUR	-0.08%	1 008.47	165 390	1 005.32	164 872	0.31%		
China Development Bank 0.375% 16/11/21	A1	Moody's	Šveits	XS1711173218	EUR	0.08%	1 001.90	1 044 981	1 003.07	1 046 204	1.96%		
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	-0.31%	1 008.70	151 305	1 025.92	153 888	0.29%		
Berkshire Hathaway 0.25% 17/01/21	AA	S&P	USA	XS1548792420	EUR	0.03%	1 008.13	806 505	1 002.50	802 003	1.50%		
JP Morgan 1.375% 16/09/21	A2	Moody's	USA	XS1110449458	EUR	-0.48%	1 031.79	782 098	1 017.22	771 055	1.44%		
JP Morgan Chase And Co 2.75% 24/08/22	A2	Moody's	USA	XS0820547825	EUR	-0.25%	1 087.27	450 130	1 059.27	438 537	0.82%		
Bank of America 04/05/23	A2	Moody's	USA	XS1602557495	EUR	-0.04%	1 010.05	537 346	1 007.07	535 762	1.00%		
Bank of America 07/02/22	A2	Moody's	USA	XS1560862580	EUR	0.20%	1 001.56	582 907	1 001.09	582 634	1.09%		
Morgan Stanley 21/05/21	A2	Moody's	USA	XS1824289901	EUR	-0.44%	993.66	578 312	1 001.79	583 042	1.09%		
Wells Fargo And Company 26/04/21	BBB+	S&P	USA	XS1400169428	EUR	-0.43%	1 002.28	544 240	1 001.92	544 042	1.02%		
Wells Fargo And Company 31/01/22	BBB+	S&P	USA	XS1558022866	EUR	-0.38%	994.05	306 167	1 004.18	309 287	0.58%		
Oodatav krediidikahju (võlainstrumendid)										- 7 057	- 0.01%		

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.12.2020

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
2. Hoised										7 749 058	14.51%	15.53%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			1 411 279	1 411 279	2.64%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%			25 670	25 670	0.05%	
Tähtajalised hoised												
LHV Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa1	Moody's	EUR	0.10%	31.08.2020	01.03.2021	2 200 746	2 200 746	4.12%	
Bigbank	Tähtajaline hoius	Eesti	NR		EUR	0.50%	11.03.2020	10.03.2021	1 522 740	1 522 740	2.85%	
Coop Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa2	Moody's	EUR	0.55%	04.08.2020	02.08.2021	2 609 846	2 609 846	4.89%	
Oodatav krediitkajaju (hoised)										- 21 223	- 0.04%	
3. Muud varad										17 860	0.03%	0.00%
Muud nõuded										17 860	0.03%	
VARAD KOKKU										53 447 533	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 27 099	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										53 420 434	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 mittekaueldavad võlaväärtpaberid

Reguleeritud turul mittekaueldavate 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 instrumenti väärtusele. Aktsiaselts LHV Varahaldus hindab jooksvalt COVID-19 potentsiaalset mõju fondi investeringutele ning täiendava info teatavaks saamisel teostab nõuetekohased ümberhindlused.