

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga 31.03.2021

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

13.04.2021

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.03.2021

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 puhaväärtusest	Osakaal fondi varade puhaväärtusest eelneval kuul
1. Väärtpaberid							41 337 626	41 577 616	89.50%	84.76%		
Võlainstrumentid							41 337 626	41 577 616	89.50%	84.76%		
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	0.24%	1 007.84	100 784	1 065.41	106 541	0.23%	
Luminor 0.792% 03/12/24	Baa2	Moody's	Eesti	XS2265801238	EUR	0.43%	1 000.02	1 100 020	1 015.56	1 117 116	2.40%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 406.97	2 409 767	5.19%	
Transpordi Varahaldus 2.85% 18/04/25 ²	NR	-	Eesti	EE3300111160	EUR	2.85%	650.00	1 905 800	658.44	1 930 544	4.16%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	-0.22%	139 180.79	139 181	133 962.18	133 962	0.29%	
Qatar 4.5% 20/01/22	AA-	S&P	Katar	XS0615236006	USD	0.56%	984.13	620 800	887.30	621 110	1.34%	
Igniis Grupe 2% 21/05/30	BBB+	S&P	Leedu	XS2177349912	EUR	1.01%	986.82	1 578 916	1 103.21	1 765 129	3.80%	
Siauliu Bankas 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 165.12	853 870	1.84%	
Korea Republic 4.25% 07/12/21	AA	S&P	Lõuna-Korea	XS0277265269	EUR	-0.33%	1 215.55	182 332	1 044.87	156 731	0.34%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	0.65%	1 010.36	1 366 011	1 025.89	1 387 010	2.99%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	0.59%	995.56	901 974	1 030.88	933 974	2.01%	
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	-0.02%	1 021.62	2 564 271	1 038.30	2 606 143	5.61%	
Latvia 0.375% 27/01/22	A+	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	-0.28%	1 004.69	73 342	1 006.04	73 441	0.16%	
PKO Bank 0.75% 25/07/21	A3	Moody's	Poola	XS1650147660	EUR	0.15%	997.96	473 034	1 006.98	477 307	1.03%	
Orange 0.5% 15/01/22	BBB+	Fitch	Prantsusmaa	FR0013396496	EUR	-0.25%	100 851.09	302 553	100 704.74	302 114	0.65%	
France Government 3.25% 25/10/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011059088	EUR	-0.52%	1.05	2 148 013	1.04	2 122 917	4.57%	
France Government 3.75% 25/04/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0010192997	EUR	0.38%	1.05	1 988 072	1.04	1 970 740	4.24%	
France Government 25/05/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0013157096	EUR	-0.60%	1.01	1 809 422	1.00	1 801 584	3.88%	
France Government 2.25% 25/10/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011337880	EUR	-0.64%	1.06	1 944 259	1.06	1 936 600	4.17%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	0.14%	991.64	1 477 549	1 109.79	1 653 587	3.56%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	0.35%	1 043.46	133 563	1 120.34	143 403	0.31%	
German Treasury Bill 14/04/2021	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001030203	EUR	-0.52%	0.01	803 506	0.01	800 123	1.72%	
German Government 3.25% 04/07/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135440	EUR	-0.39%	0.01	2 164 794	0.01	2 118 800	4.56%	
German Government 2.25% 04/09/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135457	EUR	-0.53%	0.01	2 816 148	0.01	2 767 019	5.96%	
German Government 1.5% 04/09/22	AAA	Fitch	Saksamaa	DE0001135499	EUR	-0.67%	0.01	3 123 173	0.01	3 119 514	6.72%	
Temasek 0.5% 01/03/22	Aaa	Moody's	Singapur	XS1373130902	EUR	-0.10%	1 006.82	2 649 957	1 005.94	2 647 637	5.70%	
Fortum 4% 24/05/21	BBB	Fitch	Soome	XS0629937409	EUR	0.01%	1 102.46	1 367 051	1 039.94	1 289 528	2.78%	
Neste 2.125% 17/03/22	NR	-	Soome	FI4000148671	EUR	0.58%	102 468.29	102 468	101 563.51	101 564	0.22%	
China Development Bank 01/06/21	A+	S&P	Šveits	XS1422314689	EUR	-0.15%	1 008.47	165 390	1 005.27	164 864	0.35%	
China Development Bank 0.375% 16/11/21	A1	Moody's	Šveits	XS1711173218	EUR	-0.16%	1 001.90	1 044 981	1 004.81	1 048 014	2.26%	
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	-0.34%	1 008.70	151 305	1 025.58	153 837	0.33%	
JP Morgan 1.375% 16/09/21	A2	Moody's	USA	XS1110449458	EUR	-0.43%	1 031.79	782 098	1 015.80	769 979	1.66%	
JP Morgan Chase And Co 2.75% 24/08/22	A2	Moody's	USA	XS0820547825	EUR	-0.28%	1 087.27	450 130	1 059.03	438 438	0.94%	
Bank of America 04/05/23	A2	Moody's	USA	XS1602557495	EUR	-0.02%	1 010.05	537 346	1 005.96	535 169	1.15%	
Morgan Stanley 21/05/21	A1	Moody's	USA	XS1824289901	EUR	-0.42%	993.66	578 312	1 000.60	582 349	1.25%	
Wells Fargo And Company 26/04/21	BBB+	S&P	USA	XS1400169428	EUR	-0.34%	1 002.28	544 240	1 000.47	543 256	1.17%	
Oodatav krediidikahju (võlainstrumentid)									-6 069		-0.01%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.03.2021

Krediitasutuse 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										4 899 525	10.55%	15.29%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			776 848	776 848	1.67%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%			40 299	40 299	0.09%	
Tähtajalised hoised												
Coop Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa2	Moody's	EUR	0.55%	04.08.2020	02.08.2021	2 613 426	2 613 426	5.63%	
Bigbank	Tähtajaline hoius	Eesti			EUR	0.30%	10.03.2021	10.09.2021	1 500 259	1 500 259	3.23%	
Oodatav krediitkajaju (hoised)										- 31 307	- 0.07%	
VARAD KOKKU										46 477 141	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 23 017	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										46 454 124	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 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 instrumendi väärtusele. Aktsiaselts LHV Varahaldus hindab jooksvalt COVID-19 potentsiaalset mõju fondi investeringutele ning täiendava info teatavaks saamisel teostab nõuetekohased ümberhindlused.