

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga 31.10.2023

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

14.11.2023

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



Eve Sirel



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.10.2023

Emitent/väärtpaberi nimetus	Reiting	Reifingu-agentuur*	Emitendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Tootlus aegumiseni	Keskmine soetushind ühikule (EUR)**	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)**	Turuväärtus ühikule (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhus-väärtusest	Osakaal fondi varade puhus-väärtusest eelneval kuul
1. Väärtpaberid							26 191 389	26 340 503		93.34%	98.44%	
Võlainstrumentid							24 574 550	24 430 310		86.57%	91.95%	
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	4.71%	88 854.98	977 405	87 077.64	957 854	3.39%	
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 ²	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 035.00	724 500	2.57%	
Coop Pank 5.0% 10/03/2032 ¹	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	6.21%	1 000.00	906 000	934.17	846 355	3.00%	
Kodu Kvarital 8.5% 08/07/2025 ²	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 005.43	301 629	1.07%	
Liven Kodu 10 8.5% 30/06/2027 ²	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 007.22	302 166	1.07%	
Luminor 7.75% 08/06/2027	Baa1	Moody's	Eesti	XS2633112565	EUR	6.83%	1 000.01	1 427 020	1 056.52	1 507 659	5.34%	
Luminor 7.25% 16/01/2026	Baa1	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	6.53%	1 000.03	650 020	1 069.18	694 964	2.46%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 550.08	2 413 202	8.55%	
Estonia 4.0% 12/10/2032	AA-	S&P	Eesti	XS2532370231	EUR	3.88%	998.15	1 397 416	1 011.08	1 415 507	5.02%	
Baltic Horizon Fund 08/05/28	NR	-	Eesti	EE3300003235	EUR	11.74%	100 000.00	492 857	102 702.52	506 177	1.79%	
Coop Pank ATI 10% PERPETUAL ²	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002641	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	100 833.34	201 667	0.71%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.61%	139 180.79	139 181	105 557.59	105 558	0.37%	
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	6.54%	900.65	720 520	804.64	643 714	2.28%	
Volkswagen AG 4.375% PERPETUAL	BBB	Fitch	Holland	XS2342732646	EUR	6.96%	87 534.59	437 673	81 743.92	408 720	1.45%	
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iriramaa	XS2307764311	EUR	5.06%	694.02	902 220	730.19	949 251	3.36%	
Siauliu Bankas 1.047% 07/10/25	Baa2	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	6.80%	1 000.03	600 017	930.69	558 412	1.98%	
Siauliu Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.15%	1 000.00	840 000	10 525.70	884 159	3.13%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	5.09%	1 010.36	1 366 011	960.14	1 298 114	4.60%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	5.05%	995.56	901 974	966.10	875 284	3.10%	
Citadele banka 5% 13/12/2031 ³	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	5.92%	1 000.27	750 020	9 657.01	724 276	2.57%	
Citadele banka 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	6.42%	996.28	557 914	905.27	506 952	1.80%	
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	5.46%	966.28	821 337	916.84	779 310	2.76%	
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	5.17%	1 000.06	350 020	1 024.05	358 419	1.27%	
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	5.35%	86 925.97	869 260	91 739.75	917 397	3.25%	
France Treasury Bill 24/01/2024	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127613497	EUR	3.67%	0.98	784 791	0.99	793 104	2.81%	
France Treasury Bill 29/11/2023	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127462911	EUR	3.49%	0.98	1 476 485	1.00	1 495 725	5.30%	
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	5.92%	807.20	645 758	818.25	654 599	2.32%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	4.58%	1 043.46	133 563	965.96	123 643	0.44%	
German Treasury Bill 19/06/24	AAA	S&P	Saksamaa	DE000BU0E063	EUR	3.69%	0.01	1 365 680	0.01	1 367 478	4.85%	
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	6.74%	769.77	887 543	738.55	851 548	3.02%	
BP Capital Markets 3.625% PERP	Baa1	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	6.57%	834.48	267 034	891.97	285 432	1.01%	
Oodatav krediidikahju (võlainstrumentid)										- 22 463	- 0.08%	
							Keskmine soetushind ühikule (EUR)**	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)**	Turuväärtus ühikule (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhus-väärtusest	Osakaal fondi varade puhus-väärtusest eelneval kuul
Aktsiad							668	1 255		0.00%	0.00%	
VH Agent 003 osa			Eesti	EE3100005430	EUR		1.24	387	2.08	650	0.00%	
VH Agent 004 osa			Eesti	EE3100005455	EUR		0.97	281	2.10	606	0.00%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.10.2023

Fondi osaku või aktsia nimetus	Fondivalitseja	Fondi päritoluriik	ISIN-kood	Valuuta	Keskmine soetushind ühikule (EUR)**	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)**	Turuväärtus ühikule (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul		
Fondiosakud						1 616 171		1 908 937	6.76%	6.48%		
Kinnisvarafondid						353 771		434 797	1.54%	1.55%		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	353 771	1.23	434 797	1.54%			
Aktsiafondid						1 262 400		1 474 140	5.22%	4.93%		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	527.73	1 262 400	564.59	1 474 140	5.22%			
Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Löpp-tähtaeg	Hoiustatud summa (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoiused										1 894 847	6.71%	1.61%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	Aa3	Moody's	EUR				1 894 847	1 894 847	6.71%	
VARAD KOKKU										28 235 350	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 14 874	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										28 220 476	100.00%	100.00%

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

** Keskmise soetushinna arvutamisel kasutatakse FIFO meetodit

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

² Reguleeritud turul mittekaubeldavad võlaväärtpaberid

³ Instrumenti väärtus on leitud eeskirja LHV Varahalduse investeerimisfondide vara puhasväärtuse määramise eeskiri punktis 3.3. sätestatud viisil, kuna fondivalitseja hinnangul ei ole võimalik instrumenti hinda kindlaks määrata täpselt ja usaldusväärselt turuhinna/ vastava fondi fondivalitseja avaldatud NAVi alusel.