

LHV Täiendav Pensionifond

Investeeringute aruanne seisuga 30.09.2019

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

14.10.2019

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Täiendav Pensionifond investeringute aruanne seisuga 30.09.2019

Emifent/väärtpaberi nimetus	Reiting	Reitingu-agentuur*	Emifendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Tootlus aegumiseni	Keskmine soetusühikule	Keskmine soetusväärtus kokku	Turuväärtus ühikule	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul	
1. Väärtpaberid							13 434 422	15 253 088	94.95%	95.14%			
Võlakirjad							8 301 337	8 526 999	52.60%	53.79%			
Baltic Horizon Fund 4.25% 08/05/23	BB+	S&P	Eesti	EE3300111467	EUR	3.98%	1 000.11	259 029	1 015.14	262 921	1.62%		
Luminor 1.5% 18/10/21	Baa2	Moody's	Eesti	XS1894121695	EUR	0.94%	997.01	600 202	1 025.67	617 454	3.81%		
Tartu linn 25/10/32 ²	NR	-	Eesti	EE2300110602	EUR	0.47%	0.93	29 871	0.93	29 933	0.18%		
BMW 0.125% 29/11/21	A+	S&P	Holland	XS1873143561	EUR	-0.09%	1 005.59	154 861	1 005.66	154 872	0.96%		
EDP Finance 4.125% 29/06/20	BBB-	S&P	Holland	XS0223447227	EUR	-0.08%	717.75	45 218	1 041.85	65 637	0.40%		
VW 0.5% 30/03/21	BBB+	Fitch	Holland	XS1586555606	EUR	0.01%	100 706.83	201 414	100 982.37	201 965	1.25%		
Allianz 07/12/20	AA-	Fitch	Holland	DE000A19S4T0	EUR	-0.38%	101 237.48	101 237	100 518.44	100 518	0.62%		
Daimler Int'l Finance 0 11/05/2022	A2	Moody's	Holland	DE000A19HBM3	EUR	0.05%	100 480.00	100 480	99 883.00	99 883	0.62%		
LIEENE 1.875% 10/07/28	BBB+	S&P	Leedu	XS1853999313	EUR	1.12%	983.01	98 301	1 067.20	106 720	0.66%		
Lietuvos Energija 2% 14/07/27	BBB+	S&P	Leedu	XS1466530565	EUR	0.99%	982.94	103 209	1 079.26	113 323	0.70%		
Lithuania 2.1% 06/11/24	A-	Fitch	Leedu	LT1000610014	EUR	0.04%	106.79	266 557	112.37	280 481	1.73%		
Lithuania 5.5% 17/05/22	A-	Fitch	Leedu	LT0000610057	EUR	-0.03%	0.01	73 571	0.01	67 205	0.41%		
Lithuania 4.1% 28/02/23	A	S&P	Leedu	LT0000610065	EUR	0.00%	0.01	235 760	0.01	235 962	1.46%		
Korea Republic 4.25% 07/12/21	AA	S&P	Lõuna-Korea	XS0277265269	EUR	-0.30%	1 215.55	18 233	1 134.51	17 018	0.10%		
Citadele banka 6.25% 06/12/2026	Ba1	Moody's	Läti	LV0000802221	EUR	6.25%	10 001.03	390 040	10 196.98	397 682	2.45%		
Citadele banka 5.5% 24/11/2027	Ba1	Moody's	Läti	LV0000880011	EUR	5.50%	10 001.25	160 020	10 192.03	163 073	1.01%		
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	0.50%	998.97	49 949	1 043.09	52 155	0.32%		
Latvenergo 2.8% 22/05/20	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801165	EUR	-0.15%	972.31	32 086	1 029.02	33 958	0.21%		
Latvia 1.375% 23/09/25	A	S&P	Läti	XS1295778275	EUR	-0.22%	993.23	193 679	1 096.51	213 820	1.32%		
Latvia 0.375% 27/01/22	A	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	0.03%	1 004.87	87 424	1 010.53	87 916	0.54%		
PKO Bank 0.75% 25/07/21	A3	Moody's	Poola	XS1650147660	EUR	0.03%	998.11	102 806	1 014.37	104 480	0.64%		
Orange 3.875% 14/01/21	Baa1	Moody's	Prantsusmaa	XS0563306314	EUR	-0.18%	53 865.55	53 866	54 000.83	54 001	0.33%		
Orange 0.5% 15/01/22	BBB+	Fitch	Prantsusmaa	FR0013396496	EUR	-0.14%	100 841.24	201 682	101 811.43	203 623	1.26%		
GECINA 30/06/22	A-	S&P	Prantsusmaa	FR0013266343	EUR	-0.09%	100 178.26	300 535	100 236.31	300 709	1.86%		
TOTAL 03/19/20	Aa3	Moody's	Prantsusmaa	XS1139316555	EUR	-0.30%	100 836.67	302 510	100 142.00	300 426	1.85%		
Romania 4.875% 07/11/19	BBB-	S&P	Rumeenia	XS0852474336	EUR	0.99%	1 099.76	109 976	1 047.67	104 767	0.65%		
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	0.41%	992.30	29 769	1 150.04	34 501	0.21%		
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	0.64%	1 043.57	158 622	1 150.82	174 924	1.08%		
Allianz 07/07/45	A	Fitch	Saksamaa	DE000A14J9N8	EUR	1.85%	97 589.26	195 179	108 460.45	216 921	1.34%		
SAP 13/03/21	A2	Moody's	Saksamaa	DE000A2G8VS7	EUR	-0.24%	100 723.33	302 170	100 346.00	301 038	1.86%		
Fortum 2.25% 06/09/22	BBB	Fitch	Soome	XS0825855751	EUR	0.02%	1 067.65	97 157	1 066.82	97 080	0.60%		
Sampo 3.375% 23/05/49	Baa1	Moody's	Soome	XS1995716211	EUR	3.35%	1 005.01	237 183	1 136.80	268 284	1.66%		
HSBC Holdings Plc 04/12/21	AA-	Fitch	Suurbritannia	XS1917614569	EUR	0.13%	1 011.01	310 380	1 007.60	309 332	1.91%		
China Development Bank 0.375% 16/11/21	A1	Moody's	Šveits	XS1711173218	EUR	-0.07%	1 001.99	318 631	1 012.75	322 054	1.99%		
Danske Bank 7% Perpetual	BB+	S&P	Taani	XS1825417535	USD	5.93%	900.96	166 860	966.14	193 228	1.19%		
Danske Bank 6.125% Perpetual	Ba1	Moody's	Taani	XS1586367945	USD	5.72%	818.91	155 962	909.84	181 967	1.12%		
Czech Republic 4.125% 18/03/20	AA-	Fitch	Tšehhi Vabariik	XS0215153296	EUR	-0.21%	1 192.80	5 964	1 042.29	5 211	0.03%		
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	-0.22%	1 008.70	15 131	1 046.86	15 703	0.10%		
Berkshire Hathaway 0.25% 17/01/21	AA	S&P	USA	XS1548792420	EUR	-0.17%	1 007.39	222 633	1 007.11	222 572	1.37%		
IBM 1.875% 06/11/20	A2	Moody's	USA	XS0991090175	EUR	-0.24%	1 084.93	21 699	1 040.19	20 804	0.13%		

LHV Täiendav Pensionifond investeringute aruanne seisuga 30.09.2019

Emitent/väärtpaber nimetus	Reiting	Reitingu-agentuur*	Emifendi 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	0.14%	1 001.61	229 369	1 007.10	230 627	1.42%	
Goldman Sachs 29/05/20	BBB+	S&P	USA	XS1240146891	EUR	-0.26%	1 001.79	229 410	1 003.82	229 875	1.42%	
JP Morgan Chase And Co 27/01/20	A2	Moody's	USA	XS1174472511	EUR	-0.36%	1 005.63	324 819	1 002.03	323 656	2.00%	
Morgan Stanley 21/05/21	BBB+	S&P	USA	XS1824289901	EUR	-0.10%	993.72	227 561	1 001.71	229 392	1.42%	
AT And T 03/08/20	A-	Fitch	USA	XS1862437909	EUR	-0.22%	1 004.85	135 655	1 002.03	135 273	0.83%	
AT And T 05/09/23	BBB	S&P	USA	XS1907118464	EUR	0.06%	1 013.85	136 870	1 014.20	136 917	0.84%	
UPS 15/07/20	A2	Moody's	USA	XS1323463056	EUR	-0.24%	1 010.21	283 868	1 002.52	281 708	1.74%	
Wells Fargo And Company 26/04/21	A-	S&P	USA	XS1400169428	EUR	-0.22%	1 002.60	143 371	1 007.70	144 101	0.89%	
Wells Fargo And Company 31/01/22	A-	S&P	USA	XS1558022866	EUR	-0.03%	994.59	80 561	1 004.09	81 331	0.50%	

Emitent/väärtpaber nimetus	Emifendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Keskmine soetushind ühikule	Keskmine soetusväärtus kokku	Turuväärtus ühikule	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
Aktsiad					2 024 420		2 520 436	15.55%	13.37%
Arco Vara	Eesti	EE3100034653	EUR	1.19	12 397	1.07	11 118	0.07%	
Ekspress Grupp	Eesti	EE3100016965	EUR	1.37	80 813	0.78	45 620	0.28%	
Tallink Grupp	Eesti	EE3100004466	EUR	0.72	194 574	0.95	256 210	1.58%	
Tallinna Kaubamaja	Eesti	EE0000001105	EUR	5.25	159 269	8.12	246 288	1.52%	
Tallinna Sadam	Eesti	EE3100021635	EUR	1.70	168 030	1.97	194 223	1.20%	
Banco Santander	Hispaania	ES0113900337	EUR	3.53	105 392	3.74	111 516	0.69%	
Seven and i Holdings	Jaapan	JP3422950000	JPY	42.77	36 603	35.14	32 679	0.20%	
Rakuten Inc	Jaapan	JP3967200001	JPY	9.38	43 617	9.06	45 284	0.28%	
Apranga	Leedu	LT0000102337	EUR	2.34	36 944	1.99	31 294	0.19%	
Grigeo	Leedu	LT0000102030	EUR	0.63	13 730	1.31	28 580	0.18%	
Linus Agro	Leedu	LT0000128092	EUR	0.58	58 680	0.63	63 776	0.39%	
Novaturas	Leedu	LT0000131872	EUR	10.50	101 063	6.60	63 525	0.39%	
Siauliu Bankas	Leedu	LT0000102253	EUR	0.22	9 868	0.51	23 108	0.14%	
Olainfarm	Läti	LV0000100501	EUR	3.86	91 269	6.72	158 834	0.98%	
Thales	Prantsusmaa	FR0000121329	EUR	103.86	53 281	105.50	54 122	0.33%	
Orange	Prantsusmaa	FR0000133308	EUR	9.81	28 367	14.40	41 630	0.26%	
Swedbank	Rootsi	SE0000242455	SEK	12.03	107 584	13.25	117 763	0.73%	
Metro AG	Saksamaa	DE0008F80019	EUR	18.76	48 154	14.48	37 170	0.23%	
Daimler	Saksamaa	DE0007100000	EUR	67.45	26 979	45.62	18 248	0.11%	
Ceconomy AG	Saksamaa	DE0007257503	EUR	8.69	22 295	4.97	12 750	0.08%	
Siemens	Saksamaa	DE0007236101	EUR	111.57	139 457	98.25	122 813	0.76%	
Volkswagen	Saksamaa	DE0007664039	EUR	135.48	67 740	156.06	78 030	0.48%	
Kesko	Soome	FI0009000202	EUR	21.41	42 604	57.96	115 340	0.71%	
Metsa Board 1	Soome	FI0009000665	EUR	5.16	24 583	5.46	25 982	0.16%	
Neste Oil	Soome	FI0009013296	EUR	3.17	25 706	30.37	245 997	1.52%	
Nokian Renkaat	Soome	FI0009005318	EUR	28.56	28 503	25.88	25 828	0.16%	
Stora Enso	Soome	FI0009005961	EUR	8.52	69 571	11.06	90 231	0.56%	
Roche Holding	Šveits	CH0012032048	CHF	225.73	49 018	267.77	58 909	0.36%	
PFNONWOVENS	Tšehhi Vabariik	LU0275164910	CZK	31.64	33 513	26.65	28 516	0.18%	
Newmont Mining	USA	US6516391066	USD	25.01	62 826	34.82	91 692	0.57%	
Bank Saint Petersburg	Venemaa	RU0009100945	RUB	0.84	81 989	0.72	43 360	0.27%	

LHV Täiendav Pensionifond investeringute aruanne seisuga 30.09.2019

Fondi osaku või aktsia nimetus	Fondivalitseja	Fondi päritoluriik	ISIN-kood	Valuuta	Keskmine soetushind ühikule	Keskmine soetusväärtus kokku	Turuväärtus ühikule	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
Fondiosakud						3 359 359		4 620 404	28.50%	27.79%
Kinnisvarafondid						1 613 034		2 250 246	13.88%	13.65%
EFTEN Real Estate Fund III	EFTEN Capital	Eesti	EE3100127242	EUR	16.00	25 936	17.80	28 854	0.18%	
EFTEN Kinnisvarafond	EFTEN Capital	Eesti	EE3100097411	EUR	1.55	491 069	2.63	832 901	5.14%	
Birdeye Timber Fund	Birdeye Capital	Eesti	EE3500110186	EUR	9.77	35 157	12.90	46 430	0.29%	
Birdeye Timber Fund 2	Birdeye Capital	Eesti	EE3500110269	EUR	10.96	100 000	11.83	107 952	0.67%	
Usaldusfond EFTEN Real Estate Fund 4	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	88 551	1.07	94 319	0.58%	
East Capital Baltic Property Fund II	East Capital Real Estate	Luksemburg	LU0758647282	EUR	102.61	246 085	177.37	425 381	2.62%	
East Capital Baltic Property Fund III	East Capital Real Estate	Luksemburg	LU1274822847	EUR	125.37	489 044	142.23	554 797	3.42%	
SG Capital Partners Fund 1	SG Capital Partners	Läti	-	EUR	1.00	137 192	1.16	159 612	0.98%	
Aktsiafondid						1 365 243		1 644 593	10.15%	9.82%
iShares MSCI Japan EUR Hedged UCITS ETF	Blackrock Asset Management Ireland	Iriraama	IE00B42Z5J44	EUR	39.01	190 985	46.94	229 794	1.42%	
Invesco Asia Opportunities Equity Fund	Invesco Management	Luksemburg	LU0115143082	EUR	104.41	24 500	103.80	24 356	0.15%	
JF China A	JPMorgan Asset Management Europe	Luksemburg	LU0051755006	USD	55.02	19 583	59.09	27 301	0.17%	
Pictet Water P Cap	Pictet Funds Europe	Luksemburg	LU0104884860	EUR	154.45	52 110	348.37	117 537	0.73%	
Fondul Proprietatea	Templeton Asset Management	Rumeenia	ROFPTAACNOR5	RON	0.13	25 976	0.25	44 597	0.28%	
iShares DAX EX	Blackrock Asset Management Deutschland	Saksamaa	DE0005933931	EUR	103.70	414 800	106.52	426 080	2.63%	
iShares STOXX Europe 600 DE	Blackrock Asset Management Deutschland	Saksamaa	DE0002635307	EUR	27.99	193 862	38.79	268 698	1.66%	
iShares STOXX Europe 600 Health Care	Blackrock Asset Management Deutschland	Saksamaa	DE000A0Q4R36	EUR	75.36	211 008	84.52	236 656	1.46%	
Aberdeen Emerging Markets Equity Income Fund	Aberdeen Asset Managers	USA	US00301W1053	USD	9.76	21 669	6.39	15 628	0.10%	
WisdomTree Japan Hedged Equity Fund	WisdomTree Investments	USA	US97717W8516	USD	39.24	210 750	46.34	253 945	1.57%	
Erakapitalifondid						367 582		705 513	4.35%	4.19%
Baltcap Lithuania SME Fund KÜB	BaltCap	Leedu	-	EUR	1.00	32 072	3.19	102 373	0.63%	
INVL Baltic Sea Growth Fund	INVL Asset Management	Leedu	-	EUR	1.00	35 965	0.98	35 141	0.22%	
KJK Fund III S.C.A. SICAV-RAIF	KJK Management	Luksemburg	LU1840779810	EUR	1 000.00	165 000	1 042.48	172 009	1.06%	
KJK Fund II Sicav-SIF Balkan	KJK Management	Luksemburg	LU0802715499	EUR	114.59	6 036	2 151.19	113 314	0.70%	
KJK Fund II Sicav-SIF Balkan	KJK Management	Luksemburg	LU0871721717	EUR	121.02	6 362	2 149.05	112 971	0.70%	
BaltCap Private Equity Fund II	BaltCap	Luksemburg	-	EUR	1.00	89 335	1.68	150 265	0.93%	
BaltCap Latvia Venture Capital Fund K.S.	BaltCap	Läti	-	EUR	1.00	32 812	0.59	19 440	0.12%	
Võlakirjafondid						13 500		20 053	0.12%	0.13%
JPMF Global Convertible Bond Fund	JPMorgan Asset Management Europe	Luksemburg	LU0129412341	EUR	7.92	13 500	11.76	20 053	0.12%	

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										536 786	3.31%	5.02%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto CHF, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	CHF	0.00%			2 653	2 653	0.02%	
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			396 499	396 499	2.45%	
Arvelduskonto JPY, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	JPY	0.00%			1 563	1 563	0.01%	

LHV Täiendav Pensionifond investeringute aruanne seisuga 30.09.2019

Krediitasutuse 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
Arvelduskonto RON, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	RON	0.00%			7 872	7 872	0.05%	
Arvelduskonto RUB, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	RUB	0.00%			3 848	3 848	0.02%	
Arvelduskonto SEK, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	SEK	0.00%			68	68	0.00%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%			124 282	124 282	0.77%	
3. Muud varad										19 347	0.12%	0.12%
Laekumata dividendid										19 347	0.12%	
VARAD KOKKU										16 223 972	100.09%	100.09%
Fondi kohustused										- 14 046	- 0.09%	- 0.09%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										16 209 926	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