

LHV Täiendav Pensionifond

Investeeringute aruanne seisuga **29.02.2020**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

12.03.2020

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Täiendav Pensionifond investeringute aruanne seisuga 29.02.2020

Emifent/väärtpaberit nimetus	Reifing	Reifingu-agentuur*	Emifendi 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							13 535 796	15 549 416	95.80%	94.74%			
Võlakirjad							8 401 159	8 626 524	53.15%	52.47%			
Baltic Horizon Fund 4.25% 08/05/23	BB+	S&P	Eesti	EE3300111467	EUR	3.95%	1 000.11	259 029	1 011.48	261 973	1.61%		
INBANK 6% 19/12/29	NR	-	Eesti	EE3300001544	EUR	5.46%	1 000.80	4 003	1 052.67	4 211	0.03%		
Luminor 1.5% 18/10/21	Baa2	Moody's	Eesti	XS1894121695	EUR	0.39%	997.01	600 202	1 023.49	616 142	3.80%		
Tartu linn 25/10/32 ²	NR	-	Eesti	EE2300110602	EUR	0.47%	0.86	27 622	0.86	27 669	0.17%		
BMW 0.125% 29/11/21	A+	S&P	Holland	XS1873143561	EUR	-0.18%	1 005.59	154 861	1 005.71	154 880	0.95%		
EDP Finance 4.125% 29/06/20	BBB-	S&P	Holland	XS0223447227	EUR	-0.19%	717.75	45 218	1 041.95	65 643	0.40%		
VW 0.5% 30/03/21	BBB+	Fitch	Holland	XS1586555606	EUR	-0.04%	100 706.83	201 414	101 041.02	202 082	1.25%		
Allianz 07/12/20	AA-	Fitch	Holland	DE000A19S470	EUR	-0.32%	101 237.48	101 237	100 352.92	100 353	0.62%		
Daimler Intl Finance 0 11/05/2022	A3	Moody's	Holland	DE000A19HBM3	EUR	-0.02%	100 480.00	100 480	100 035.00	100 035	0.62%		
Ignitis grupe 1.875% 10/07/28	BBB+	S&P	Leedu	XS1853999313	EUR	0.72%	983.01	98 301	1 105.74	110 574	0.68%		
Ignitis grupe 2% 14/07/27	BBB+	S&P	Leedu	XS1646530565	EUR	0.61%	982.94	103 209	1 112.57	116 820	0.72%		
Siauliu Bankas 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.15%	10 000.00	240 000	10 114.26	242 742	1.50%		
Lithuania 2.1% 06/11/24	A	Fitch	Leedu	LT1000610014	EUR	0.00%	106.79	266 557	110.49	275 782	1.70%		
Lithuania 5.5% 17/05/22	A	Fitch	Leedu	LT0000610057	EUR	0.02%	0.01	73 571	0.01	67 137	0.41%		
Lithuania 4.1% 28/02/23	A+	S&P	Leedu	LT0000610065	EUR	0.01%	0.01	235 760	0.01	227 602	1.40%		
Korea Republic 4.25% 07/12/21	AA	S&P	Lõuna-Korea	XS0277265269	EUR	-0.42%	1 215.55	18 233	1 092.87	16 393	0.10%		
Citadele banka 6.25% 06/12/2026	Baa3	Moody's	Läti	LV0000802221	EUR	6.25%	10 001.03	390 040	10 143.95	395 614	2.44%		
Citadele banka 5.5% 24/11/2027	Baa3	Moody's	Läti	LV0000800111	EUR	5.50%	10 001.25	160 020	10 145.64	162 330	1.00%		
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	0.31%	998.97	49 949	1 049.71	52 485	0.32%		
Latvenergo 2.8% 22/05/20	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801165	EUR	-0.06%	972.31	32 086	1 028.15	33 929	0.21%		
Latvia 1.375% 23/09/25	A+	S&P	Läti	XS1295778275	EUR	-0.16%	993.23	193 679	1 092.04	212 948	1.31%		
Latvia 0.375% 27/01/22	A+	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	-0.15%	1 004.87	87 424	1 010.34	87 900	0.54%		
PKO Bank 0.75% 25/07/21	A3	Moody's	Poola	XS1650147660	EUR	-0.01%	998.11	102 806	1 015.08	104 553	0.64%		
Orange 3.875% 14/01/21	Baa1	Moody's	Prantsusmaa	XS0563306314	EUR	-0.21%	53 865.55	53 866	52 032.51	52 033	0.32%		
Orange 0.5% 15/01/22	BBB+	Fitch	Prantsusmaa	FR0013396496	EUR	-0.13%	100 841.24	201 682	101 251.48	202 503	1.25%		
GECINA 30/06/22	A-	S&P	Prantsusmaa	FR0013266343	EUR	-0.11%	100 178.26	300 535	100 248.00	300 744	1.85%		
TOTAL 03/19/20	Aa3	Moody's	Prantsusmaa	XS1139316555	EUR	-0.38%	100 836.67	302 510	100 016.00	300 048	1.85%		
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	0.47%	992.30	29 769	1 120.19	33 606	0.21%		
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	0.69%	1 043.57	158 622	1 123.12	170 715	1.05%		
Allianz 07/07/45	A	Fitch	Saksamaa	DE000A14J9N8	EUR	2.37%	97 589.26	195 179	108 371.14	216 742	1.34%		
SAP 13/03/21	A2	Moody's	Saksamaa	DE000A2G8V57	EUR	-0.15%	100 723.33	302 170	100 148.00	300 444	1.85%		
Fortum 2.25% 06/09/22	BBB	Fitch	Soome	XS0825855751	EUR	-0.09%	1 067.65	97 157	1 069.79	97 351	0.60%		
Sampo 3.375% 23/05/49	Baa1	Moody's	Soome	XS1995716211	EUR	3.35%	1 005.01	237 183	1 138.86	268 772	1.66%		
HSBC Holdings Plc 04/12/21	AA-	Fitch	Suurbritannia	XS1917614569	EUR	0.20%	1 011.01	310 380	1 006.49	308 992	1.90%		
China Development Bank 0.375% 16/11/21	A1	Moody's	Šveits	XS1711173218	EUR	-0.12%	1 001.99	318 631	1 009.57	321 042	1.98%		
Danske Bank 7% Perpetual	BB+	S&P	Taani	XS1825417535	USD	5.29%	893.74	166 860	999.59	199 918	1.23%		
Danske Bank 6.125% Perpetual	Ba2	Moody's	Taani	XS1586367945	USD	5.16%	812.35	155 962	956.04	191 207	1.18%		
Czech Republic 4.125% 18/03/20	Aa3	Moody's	Tšehhi Vabariik	XS0215153296	EUR	-2.67%	1 192.80	5 964	1 042.59	5 213	0.03%		
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	-0.29%	1 008.70	15 131	1 037.88	15 568	0.10%		
Berkshire Hathaway 0.25% 17/01/21	AA	S&P	USA	XS1548792420	EUR	-0.18%	1 007.39	222 633	1 004.13	221 914	1.37%		
IBM 1.875% 06/11/20	A2	Moody's	USA	XS0991090175	EUR	-0.23%	1 084.93	21 699	1 020.39	20 408	0.13%		
JP Morgan 1.375% 16/09/21	A2	Moody's	USA	XS1110449458	EUR	-0.19%	1 032.13	155 852	1 030.39	155 588	0.96%		
JP Morgan Chase And Co 2.75% 24/08/22	A2	Moody's	USA	XS0820547825	EUR	-0.06%	1 087.38	137 010	1 084.06	136 592	0.84%		

LHV Täiendav Pensionifond investeringute aruanne seisuga 29.02.2020

Emitent/väärtpaberi nimetus	Reiting	Reitingu-agentuur*	Emifendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Tootlus aegumiseni	Keskmine soetusväärtus 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	0.13%	1 001.61	229 369	1 005.42	230 242	1.42%	
Goldman Sachs 29/05/20	BBB+	S&P	USA	XS1240146891	EUR	-0.24%	1 001.79	229 410	1 001.28	229 293	1.41%	
Morgan Stanley 21/05/21	BBB+	S&P	USA	XS1824289901	EUR	-0.03%	993.72	227 561	1 000.41	229 094	1.41%	
AT And T 03/08/20	A-	Fitch	USA	XS1862437909	EUR	-0.25%	1 004.85	135 655	1 001.10	135 149	0.83%	
AT And T 05/09/23	BBB	S&P	USA	XS1907118464	EUR	0.06%	1 013.85	136 870	1 014.89	137 010	0.84%	
UPS 15/07/20	A2	Moody's	USA	XS1323463056	EUR	-0.31%	1 010.21	283 868	1 001.36	281 383	1.73%	
Wells Fargo And Company 26/04/21	A-	S&P	USA	XS1400169428	EUR	-0.22%	1 002.60	143 371	1 005.47	143 783	0.89%	
Wells Fargo And Company 31/01/22	A-	S&P	USA	XS1558022866	EUR	-0.14%	994.59	80 561	1 004.64	81 376	0.50%	

Emitent/väärtpaberi nimetus	Emifendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Keskmine soetusväärtus ühikule	Keskmine soetusväärtus kokku	Turuväärtus ühikule	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
Aktsiad					2 095 554		2 597 292	16.00%	16.14%
Arco Vara	Eesti	EE3100034653	EUR	1.19	12 397	1.25	12 989	0.08%	
Coop Pank	Eesti	EE3100007857	EUR	1.15	11 500	1.10	11 000	0.07%	
Ekspress Grupp	Eesti	EE3100016965	EUR	1.37	80 813	0.83	48 858	0.30%	
Tallink Grupp	Eesti	EE3100004466	EUR	0.72	194 574	0.92	248 085	1.53%	
Tallinna Kaubamaja	Eesti	EE0000001105	EUR	5.25	159 269	8.96	271 766	1.67%	
Tallinna Sadam	Eesti	EE3100021635	EUR	1.70	168 030	1.97	194 223	1.20%	
Banco Santander	Hispaania	ES0113900J37	EUR	3.53	105 392	3.33	99 294	0.61%	
Seven and i Holdings ¹	Jaapan	JP3422950000	JPY	42.13	36 603	30.97	28 798	0.18%	
Rakuten Inc	Jaapan	JP3967200001	JPY	9.24	43 617	7.57	37 827	0.23%	
Agnico Eagle Mines	Kanada	CA0084741085	USD	46.03	53 200	43.30	49 188	0.30%	
Barrick Gold Corp	Kanada	CA0679011084	USD	16.30	242 261	17.35	259 573	1.60%	
Apranga	Leedu	LT0000102337	EUR	2.34	36 944	1.96	30 899	0.19%	
Grigeo	Leedu	LT0000102030	EUR	0.65	11 945	1.09	20 056	0.12%	
Linax Agro	Leedu	LT0000128092	EUR	0.58	42 348	0.58	42 416	0.26%	
Novaturas ¹	Leedu	LT0000131872	EUR	10.50	101 063	3.06	29 453	0.18%	
Siauliu Bankas	Leedu	LT0000102253	EUR	0.22	9 868	0.49	22 066	0.14%	
Olainfarm	Läti	LV0000100501	EUR	3.86	91 269	6.62	156 470	0.96%	
Thales	Prantsusmaa	FR0000121329	EUR	103.86	53 281	90.80	46 580	0.29%	
Daimler ¹	Saksamaa	DE0007100000	EUR	67.45	26 979	37.54	15 016	0.09%	
Siemens ¹	Saksamaa	DE0007236101	EUR	111.57	83 674	93.20	69 900	0.43%	
Volkswagen	Saksamaa	DE0007664039	EUR	135.48	33 870	148.58	37 145	0.23%	
Kesko	Soome	FI0009000202	EUR	21.41	42 604	61.34	122 067	0.75%	
Metsa Board	Soome	FI0009000665	EUR	5.16	24 583	5.17	24 625	0.15%	
Neste Oil	Soome	FI0009013296	EUR	3.17	25 706	35.66	288 846	1.78%	
Stora Enso	Soome	FI0009005961	EUR	8.52	69 571	10.71	87 415	0.54%	
Wartsila ¹	Soome	FI0009003727	EUR	10.51	53 372	9.40	47 772	0.29%	
Roche Holding	Šveits	CH0012032048	CHF	230.68	49 018	291.78	64 193	0.40%	
PFNONWOVENS	Tšehhi Vabariik	LU0275164910	CZK	32.17	33 513	24.42	26 128	0.16%	
Freeport-McMoRan	USA	US35671D8570	USD	8.75	53 475	9.07	55 448	0.34%	
Newmont Mining	USA	US6516391066	USD	24.81	62 826	40.66	107 052	0.66%	
Bank Saint Petersburg	Venemaa	RU0009100945	RUB	0.80	81 989	0.70	42 144	0.26%	

LHV Täiendav Pensionifond investeringute aruanne seisuga 29.02.2020

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						3 039 083		4 325 600	26.65%	26.12%		
Kinnisvarafondid						1 729 490		2 426 115	14.95%	14.18%		
EFTEN Real Estate Fund III	EFTEN Capital	Eesti	EE3100127242	EUR	16.00	25 936	18.30	29 664	0.18%			
EFTEN Kinnisvarafond	EFTEN Capital	Eesti	EE3100097411	EUR	1.55	491 069	2.75	872 406	5.38%			
Birdeye Timber Fund	Birdeye Capital	Eesti	EE3500110186	EUR	9.77	35 157	13.14	47 292	0.29%			
Birdeye Timber Fund 2	Birdeye Capital	Eesti	EE3500110269	EUR	10.96	100 000	12.49	113 927	0.70%			
Usaldusfond EFTEN Real Estate Fund 4	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	119 914	1.08	129 896	0.80%			
Lords LB Baltic Green Fund (V)	Lords LB Asset Management	Leedu	-	EUR	1.00	84 000	1.00	84 000	0.52%			
East Capital Baltic Property Fund II	East Capital Real Estate	Luksemburg	LU0758647282	EUR	102.61	246 085	174.50	418 498	2.58%			
East Capital Baltic Property Fund III	East Capital Real Estate	Luksemburg	LU1274822847	EUR	125.37	489 044	142.09	554 251	3.41%			
SG Capital Partners Fund 1	SG Capital Partners	Läti	-	EUR	1.00	138 285	1.27	176 180	1.09%			
Aktsiafondid						960 875		1 142 516	7.04%	7.55%		
iShares MSCI Japan EUR Hedged UCITS ETF	Blackrock Asset Management Ireland	Iririma	IE00B42Z5J44	EUR	39.01	190 985	43.89	214 871	1.32%			
Pictet Water P Cap	Pictet Funds Europe	Luksemburg	LU0104884860	EUR	154.45	52 110	346.04	116 751	0.72%			
iShares DAX EX	Blackrock Asset Management Deutschland	Saksamaa	DE0005933931	EUR	99.04	198 070	101.78	203 560	1.25%			
iShares STOXX Europe 600 DE	Blackrock Asset Management Deutschland	Saksamaa	DE0002635307	EUR	27.99	97 953	37.26	130 410	0.80%			
iShares STOXX Europe 600 Health Care	Blackrock Asset Management Deutschland	Saksamaa	DE000A0Q4R36	EUR	75.36	211 008	86.46	242 088	1.49%			
WisdomTree Japan Hedged Equity Fund	WisdomTree Investments	USA	US97717W8516	USD	38.93	210 750	42.85	234 836	1.45%			
Erakapitalifondid						335 218		736 491	4.54%	4.26%		
BaltCap Lithuania SME Fund KÜB	BaltCap	Leedu	-	EUR	1.00	32 072	3.45	110 795	0.68%			
INVL Baltic Sea Growth Fund	INVL Asset Management	Leedu	-	EUR	1.00	23 611	1.19	28 152	0.17%			
KJK Fund III S.C.A. SICAV-RAIF	KJK Management	Luksemburg	LU1840779810	EUR	1 000.00	165 000	1 170.95	193 207	1.19%			
KJK Fund II Sicav-SIF Balkan	KJK Management	Luksemburg	LU0802715499	EUR	114.59	6 036	2 422.26	127 593	0.79%			
KJK Fund II Sicav-SIF Balkan	KJK Management	Luksemburg	LU0871721717	EUR	100.74	5 296	2 412.33	126 811	0.78%			
BaltCap Private Equity Fund II	BaltCap	Luksemburg	-	EUR	1.00	70 390	1.86	130 644	0.80%			
BaltCap Latvia Venture Capital Fund K.S.	BaltCap	Läti	-	EUR	1.00	32 812	0.59	19 289	0.12%			
Võlakirjafondid						13 500		20 480	0.13%	0.13%		
JPMF Global Convertible Bond Fund	JPMorgan Asset Management Europe	Luksemburg	LU0129412341	EUR	7.92	13 500	12.01	20 480	0.13%			
Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intruss	Algus-kuupäev	Löpp-ähtaeg	Hoiustatud summa	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoiused										693 978	4.28%	5.35%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto CHF, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	CHF	0.00%			2 711	2 711	0.02%	
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			820 055	820 055	5.05%	
Arvelduskonto JPY, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	JPY	0.00%			1 853	1 853	0.01%	
Arvelduskonto RUB, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	RUB	0.00%			3 699	3 699	0.02%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%			- 134 341	- 134 341	- 0.83%	

LHV Täiendav Pensionifond investeringute aruanne seisuga 29.02.2020

3. Muud varad	955	0.01%	0.00%
Laekumata dividendid	955	0.01%	
VARAD KOKKU	16 244 348	100.09%	100.09%
Fondi kohustused	- 13 865	- 0.09%	- 0.09%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS	16 230 483	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