

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **30.11.2020**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

11.12.2020

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 30.11.2020

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							44 813 191	44 980 799	84.52%	86.38%		
Võlainstrumendid							44 813 191	44 980 799	84.52%	86.38%		
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	0.48%	1 007.84	100 784	1 057.51	105 751	0.20%	
Luminor 0.792% 03/12/24	Baa2	Moody's	Eesti	XS2265801238	EUR	0.79%	1 000.02	1 100 020	1 000.00	1 100 000	2.07%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 684.25	2 416 422	4.54%	
Transpordi Varahaldus 2.85% 18/04/25 ²	NR	-	Eesti	EE3300111160	EUR	2.85%	650.00	1 905 800	652.21	1 912 288	3.59%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	-0.37%	139 180.79	139 181	135 223.96	135 224	0.25%	
Banco Santander 3.875% 06/02/26	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900129	EUR	-0.42%	87 484.59	349 938	125 747.06	502 988	0.95%	
Banco Santander 1.375% 14/12/22	A	Fitch	Hispaania	XS1330948818	EUR	-0.33%	105 501.19	527 506	104 824.40	524 122	0.98%	
VW 0.5% 30/03/21	BBB+	Fitch	Holland	XS1586555606	EUR	-0.35%	100 700.16	604 201	100 613.62	603 682	1.13%	
Allianz 07/12/20	AA-	Fitch	Holland	DE000A19S4T0	EUR	-0.49%	101 250.74	1 518 761	100 010.67	1 500 160	2.82%	
IPIC GMTN 5.875% 14/03/21	AA	Fitch	Kaimanisaared	XS0605559821	EUR	-0.68%	1 249.34	999 472	1 060.85	848 680	1.59%	
Qatar 4.5% 20/01/22	AA-	S&P	Katar	XS0615236006	USD	0.61%	963.18	620 800	885.08	619 553	1.16%	
Ignitis Grupe 2% 21/05/30	BBB+	S&P	Leedu	XS2177349912	EUR	0.91%	986.82	1 578 916	1 108.58	1 773 721	3.33%	
Siaulių Bankas 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.15%	10 000.00	840 000	10 576.35	888 414	1.67%	
Korea Republic 4.25% 07/12/21	AA	S&P	Lõuna-Korea	XS0277265269	EUR	-0.38%	1 215.55	182 332	1 089.13	163 369	0.31%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	1.30%	1 010.36	1 366 011	1 009.55	1 364 905	2.56%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	0.72%	995.56	901 974	1 023.57	927 352	1.74%	
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	0.13%	1 021.62	2 564 271	1 036.01	2 600 374	4.89%	
Latvia 2.625% 21/01/21	A+	S&P	Läti	XS1017763100	EUR	-0.53%	1 051.75	631 050	1 027.02	616 212	1.16%	
Latvia 0.375% 27/01/22	A+	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	-0.34%	1 004.69	73 342	1 011.44	73 835	0.14%	
PKO Bank 0.75% 25/07/21	A3	Moody's	Poola	XS1650147660	EUR	0.13%	997.96	473 034	1 006.61	477 133	0.90%	
BNP Paribas 2.875% 24/10/22	AA-	Fitch	Prantsusmaa	XS0847433561	EUR	-0.34%	1 090.87	556 342	1 064.22	542 754	1.02%	
Orange 3.875% 14/01/21	Baa1	Moody's	Prantsusmaa	XS0563306314	EUR	-0.18%	53 860.24	161 581	51 948.28	155 845	0.29%	
Orange 0.5% 15/01/22	BBB+	Fitch	Prantsusmaa	FR0013396496	EUR	-0.25%	100 851.09	302 553	101 284.16	303 852	0.57%	
France Government 3.25% 25/10/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011059088	EUR	-0.62%	1.07	857 944	1.04	830 612	1.56%	
France Government 3.75% 25/04/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0010192997	EUR	-0.58%	1.05	1 988 072	1.04	1 975 791	3.71%	
France Government 25/05/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0013157096	EUR	-0.64%	1.01	1 809 422	1.00	1 805 508	3.39%	
France Government 2.25% 25/10/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011337880	EUR	-0.71%	1.12	39 189	1.06	37 065	0.07%	
Investor 4.5% 12/05/23	Aa3	Moody's	Rootsi	XS0625859516	EUR	-0.28%	1 242.74	1 854 169	1 142.29	1 704 303	3.20%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	0.47%	991.64	1 477 549	1 095.35	1 632 070	3.07%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	0.69%	1 043.46	133 563	1 101.41	140 981	0.26%	
German Treasury Bill 14/04/2021	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001030203	EUR	-0.69%	0.01	803 506	0.01	802 096	1.51%	
German Government 3.25% 04/07/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135440	EUR	-0.65%	0.01	2 433 287	0.01	2 383 966	4.48%	
German Government 2.25% 04/09/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135457	EUR	-0.66%	0.01	1 790 769	0.01	1 747 078	3.28%	
Temasek 0.5% 01/03/22	Aaa	Moody's	Singapur	XS1373130902	EUR	-0.06%	1 006.82	2 649 957	1 010.72	2 660 224	5.00%	
Fortum 2.25% 06/09/22	BBB	Fitch	Soome	XS0825855751	EUR	-0.16%	1 049.15	462 675	1 047.95	462 146	0.87%	
Fortum 4% 24/05/21	BBB	Fitch	Soome	XS0629937409	EUR	-0.24%	1 102.46	1 367 051	1 041.22	1 291 115	2.43%	
Neste 2.125% 17/03/22	NR	-	Soome	FI4000148671	EUR	0.50%	102 468.29	102 468	103 593.05	103 593	0.19%	
Sampo 3.375% 23/05/49	Baa1	Moody's	Soome	XS1995716211	EUR	3.18%	1 039.76	1 189 489	1 153.85	1 320 006	2.48%	
China Development Bank 01/06/21	A+	S&P	Šveits	XS1422314689	EUR	-0.10%	1 008.47	165 390	1 005.45	164 894	0.31%	
China Development Bank 0.375% 16/11/21	A1	Moody's	Šveits	XS1711173218	EUR	-0.06%	1 001.90	1 044 981	1 004.30	1 047 489	1.97%	
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	-0.34%	1 008.70	151 305	1 026.76	154 014	0.29%	
Berkshire Hathaway 0.25% 17/01/21	AA	S&P	USA	XS1548792420	EUR	0.02%	1 008.13	806 505	1 002.42	801 938	1.51%	
JP Morgan 1.375% 16/09/21	A2	Moody's	USA	XS1110449458	EUR	-0.50%	1 031.79	782 098	1 017.78	771 474	1.45%	
JP Morgan Chase And Co 2.75% 24/08/22	A2	Moody's	USA	XS0820547825	EUR	-0.31%	1 087.27	450 130	1 060.69	439 127	0.83%	
Bank of America 04/05/23	A2	Moody's	USA	XS1602557495	EUR	-0.03%	1 010.05	537 346	1 007.33	535 898	1.01%	
Bank of America 07/02/22	A2	Moody's	USA	XS1560862580	EUR	0.16%	1 001.56	582 907	1 001.57	582 911	1.10%	
Morgan Stanley 21/05/21	A2	Moody's	USA	XS1824289901	EUR	-0.45%	993.66	578 312	1 002.15	583 251	1.10%	
Wells Fargo And Company 26/04/21	BBB+	S&P	USA	XS1400169428	EUR	-0.46%	1 002.28	544 240	1 002.37	544 285	1.02%	
Wells Fargo And Company 31/01/22	BBB+	S&P	USA	XS1558022866	EUR	-0.38%	994.05	306 167	1 004.48	309 380	0.58%	
Oodatav krediitkahju (võlainstrumendid)										- 7 050	- 0.01%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 30.11.2020

Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Löpp-fähtaeg	Hoiustatud summa	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoiused										8 266 762	15.53%	13.67%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			1 959 552	1 959 552	3.68%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%			26 294	26 294	0.05%	
Tähtajalised hoiused												
LHV Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa1	Moody's	EUR	0.10%	31.08.2020	01.03.2021	2 200 556	2 200 556	4.13%	
Bigbank	Tähtajaline hoius	Eesti	NR		EUR	0.50%	11.03.2020	10.03.2021	1 522 096	1 522 096	2.86%	
Coop Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	Baa2	Moody's	EUR	0.55%	04.08.2020	02.08.2021	2 608 652	2 608 652	4.90%	
Oodatav krediitkahju (hoiused)										- 50 388	- 0.09%	
VARAD KOKKU										53 247 561	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 26 121	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										53 221 440	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

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