

# LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga 31.05.2021

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

11.06.2021

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.05.2021

Emifent/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 puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
<b>1. Väärtpaberid</b>								<b>39 723 236</b>	<b>39 869 509</b>	<b>94.77%</b>	<b>84.82%</b>	
<b>Võlainstrumendid</b>								<b>39 723 236</b>	<b>39 869 509</b>	<b>94.77%</b>	<b>84.82%</b>	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	0.24%	1 007.84	100 784	1 065.64	106 564	0.25%	
Luminor 0.792% 03/12/24	Baa2	Moody's	Eesti	XS2265801238	EUR	0.46%	1 009.73	3 978 341	1 015.13	3 999 628	9.51%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 679.78	2 416 315	5.74%	
Transpordi Varahaldus 2.85% 18/04/25 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300111160	EUR	2.85%	600.00	1 759 200	602.04	1 765 189	4.20%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	-0.18%	139 180.79	139 181	128 962.12	128 962	0.31%	
Qatar 4.5% 20/01/22	AA-	S&P	Katar	XS0615236006	USD	0.40%	945.73	620 800	854.31	598 015	1.42%	
Siauliu Bankas 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 267.90	862 504	2.05%	
Korea Republic 4.25% 07/12/21	AA	S&P	Lõuna-Korea	XS0277265269	EUR	-0.38%	1 215.55	182 332	1 044.59	156 688	0.37%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	0.50%	1 010.36	1 366 011	1 032.74	1 396 261	3.32%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	0.35%	995.56	901 974	1 040.05	942 285	2.24%	
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	-0.06%	1 021.62	2 564 271	1 038.53	2 606 709	6.20%	
Latvia 0.375% 27/01/22	A+	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	-0.32%	1 004.69	73 342	1 005.85	73 427	0.17%	
PKO Bank 0.75% 25/07/21	A3	Moody's	Poola	XS1650147660	EUR	0.22%	997.96	473 034	1 007.16	477 394	1.13%	
Orange 0.5% 15/01/22	BBB+	Fitch	Prantsusmaa	FR0013396496	EUR	-0.33%	100 851.09	302 553	100 708.30	302 125	0.72%	
France Treasury Bill 25/08/2021	AA	Fitch	Prantsusmaa	FR0126461807	EUR	-0.63%	1.00	2 104 094	1.00	2 103 055	5.00%	
France Government 3.25% 25/10/21	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011059088	EUR	-0.58%	1.05	2 148 013	1.03	2 121 649	5.04%	
France Government 2.25% 25/10/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011337880	EUR	-0.66%	1.06	459 345	1.05	458 715	1.09%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	0.16%	991.64	1 477 549	1 109.29	1 652 849	3.93%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	0.29%	1 043.46	133 563	1 123.78	143 844	0.34%	
German Treasury Bill 25/08/2021	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001030245	EUR	-0.63%	0.01	3 806 696	0.01	3 805 662	9.05%	
German Government 3.25% 04/07/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135440	EUR	-0.39%	0.01	2 164 794	0.01	2 117 450	5.03%	
German Government 2.25% 04/09/21	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135457	EUR	-0.59%	0.01	2 816 148	0.01	2 764 941	6.57%	
German Government 1.5% 04/09/22	AAA	Fitch	Saksamaa	DE0001135499	EUR	-0.68%	0.01	3 123 173	0.01	3 116 114	7.41%	
Temasek 0.5% 01/03/22	Aaa	Moody's	Singapur	XS1373130902	EUR	-0.17%	1 006.82	2 649 957	1 006.23	2 648 388	6.30%	
China Development Bank 01/06/21	A+	S&P	Šveits	XS1422314689	EUR	0.50%	1 008.47	165 390	1 005.19	164 851	0.39%	
China Development Bank 0.375% 16/11/21	A1	Moody's	Šveits	XS1711173218	EUR	-0.16%	1 001.90	1 044 981	1 004.55	1 047 750	2.49%	
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	-0.39%	1 008.70	151 305	1 025.74	153 862	0.37%	
JP Morgan 1.375% 16/09/21	A2	Moody's	USA	XS1110449458	EUR	-0.44%	1 031.79	782 098	1 015.11	769 455	1.83%	
JP Morgan Chase And Co 2.75% 24/08/22	A2	Moody's	USA	XS0820547825	EUR	-0.38%	1 087.27	450 130	1 059.86	438 780	1.04%	
Bank of America 04/05/23	A2	Moody's	USA	XS1602557495	EUR	-0.03%	1 010.05	537 346	1 005.54	534 949	1.27%	
Oodatav krediidikahju (võlainstrumendid)										- 4 871	- 0.01%	
<b>2. Hoised</b>								<b>2 218 826</b>	<b>5.27%</b>	<b>15.23%</b>		
<b>Arvelduskontod</b>												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hois	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%		695 349		695 349	1.65%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hois	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%		38 726		38 726	0.09%	
<b>Tähtajalised hoised</b>												
Bigbank	Tähtajaline hois	Eesti			EUR	0.30%	10.03.2021	10.09.2021	1 501 011	1 501 011	3.57%	
Oodatav krediidikahju (hoised)										- 16 260	- 0.04%	

**LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.05.2021**

<b>3. Muud varad</b>	<b>879</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>
Muud nõuded	879	0.00%	
<b>VARAD KOKKU</b>	<b>42 089 213</b>	<b>100.05%</b>	<b>100.05%</b>
Fondi kohustused	- 20 677	- 0.05%	- 0.05%
<b>FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS</b>	<b>42 068 536</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.00%</b>

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

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

<sup>2</sup> Reguleeritud turul mittekaubeldavad võlaväärtpaberid

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