

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga 31.12.2021

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

14.01.2022

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeeingute aruanne seisuga 31.12.2021

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 puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
1. Väärtpaberid								29 475 480	29 556 240	87.65%	95.44%	
Võlainstrumendid								29 003 611	29 084 371	86.25%	95.44%	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	0.31%	1 007.84	100 784	1 042.21	104 221	0.31%	
Liven Kodu 10 8% 30/06/2026 ²	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.00%	1 000.00	300 000	1 000.00	300 000	0.89%	
Luminor 0.792% 03/12/24	Baa1	Moody's	Eesti	XS2265801238	EUR	0.60%	1 013.49	2 270 225	1 012.81	2 268 689	6.73%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 004.47	2 400 107	7.12%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	0.02%	139 180.79	139 181	127 626.77	127 627	0.38%	
Qatar 4.5% 20/01/22	AA-	S&P	Katar	XSO615236006	USD	1.23%	1 018.80	620 800	902.17	631 520	1.87%	
Siauliu Bankas 1.047% 07/10/25	Baa2	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	1.25%	1 000.03	600 017	1 000.44	600 263	1.78%	
Siauliu Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.15%	10 000.00	840 000	10 013.48	841 132	2.49%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	0.29%	1 010.36	1 366 011	1 042.65	1 409 662	4.18%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	0.15%	995.56	901 974	1 034.67	937 412	2.78%	
Citadele 5% 13/12/2031	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	5.00%	10 000.27	750 020	10 024.39	751 829	2.23%	
Citadele 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	1.77%	996.28	557 914	999.24	559 572	1.66%	
Latvenergo 1.9% 10/06/22	Baa2	Moody's	Läti	LV0000801777	EUR	0.08%	1 021.62	2 564 271	1 018.62	2 556 734	7.58%	
Latvia 0.375% 27/01/22	A+	S&P	Läti	LV0000570141	EUR	-0.17%	1 004.69	73 342	1 003.90	73 285	0.22%	
France Government 3% 25/04/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011196856	EUR	-0.60%	1.03	723 637	1.03	722 350	2.14%	
France Government 2.25% 25/10/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011337880	EUR	-0.63%	1.05	2 513 382	1.03	2 451 279	7.27%	
Eastnine 08/07/24	NR	-	Rootsi	SE0013719788	EUR	4.69%	1 000.01	808 011	1 019.17	823 487	2.44%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	0.57%	991.64	1 477 549	1 069.43	1 593 452	4.73%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	0.69%	1 043.46	133 563	1 082.14	138 510	0.41%	
German Treasury Bill 18/05/2022	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001030377	EUR	-0.65%	0.01	1 004 463	0.01	1 002 522	2.97%	
German Treasury Bill 23/02/2022	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001030344	EUR	-0.73%	0.01	802 440	0.01	800 890	2.37%	
German Government 2% 04/01/22	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001135465	EUR	1.96%	0.01	2 044 878	0.01	2 039 622	6.05%	
German Government 1.5% 04/09/22	AAA	Fitch	Saksamaa	DE0001135499	EUR	-0.75%	0.01	2 215 580	0.01	2 193 343	6.50%	
Temasek 0.5% 01/03/22	Aaa	Moody's	Singapur	XS1373130902	EUR	-0.95%	1 006.82	2 649 957	1 006.59	2 649 340	7.86%	
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	-0.47%	1 008.70	151 305	1 014.10	152 115	0.45%	
JP Morgan Chase And Co 2.75% 24/08/22	A2	Moody's	USA	XS0820547825	EUR	-0.44%	1 087.27	450 130	1 030.44	426 602	1.27%	
Bank of America 04/05/23	AA-	Fitch	USA	XS1602557495	EUR	0.05%	1 010.05	537 346	1 002.50	533 329	1.58%	
Oodatav krediidikahju (võlainstrumendid)										-4 525	-0.01%	
Fondi osaku või aktsia nimetus	Fondivalitseja	Fondi päritoluriik	ISIN-kood	Valuuta		Keskmine soetusväärtus ühikule	Keskmine soetusväärtus kokku	Turuväärtus ühikule	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul	
Fondiosakud								471 869	471 869	1.40%	0.00%	
Kinnisvarafondid								471 869	471 869	1.40%		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR		1.00	471 869	1.00	471 869	1.40%		
Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Lõpp-tähtaeg	Hoiustatud summa	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoiused										4 182 224	12.40%	4.60%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			3 189 075	3 189 075	9.46%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.12.2021

Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Lõpp-tähtaeg	Hoiustatud summa	Turuväärtus kokku	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
Tähtajalised hoiused												
Bigbank	Tähtajaline hoius	Eesti			EUR	0.40%	10.09.2021	09.09.2022	1 001 227	1 001 227	2.97%	
Oodatav krediitkahju (hoiused)										- 8 078	- 0.02%	
3. Muud varad										191	0.00%	0.00%
Muud nõuded										191	0.00%	
VARAD KOKKU										33 738 655	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 16 505	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										33 722 515	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 instrumenti väärtusele. Aktsiaselts LHV Varahaldus hindab jooksvalt COVID-19 potentsiaalset mõju fondi investeringutele ning täiendava info teatavaks saamisel teostab nõuetekohased ümberhindlused.