

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **31.10.2022**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

11.11.2022

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.10.2022

Emitent/väärtpaberi nimetus	Reiting	Reitingu-agentuur*	Emitendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Tootlus aegumiseni	Keskmine soetushind ühikule (EUR)	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)	Turuväärtus ühikule (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
1. Väärtpaberid							28 304 379	27 530 941	96.70%	95.68%		
Võlainstrumendid							26 644 524	25 787 371	90.58%	89.40%		
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	4.84%	88 854.98	977 405	81 711.64	898 828	3.16%	
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 ²	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 035.00	724 500	2.54%	
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	6.43%	1 000.00	906 000	904.17	819 175	2.88%	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	5.09%	1 007.84	100 784	979.36	97 936	0.34%	
Kodu Kvartal 8.5% 08/07/2025 ²	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 005.43	301 629	1.06%	
Liven Kodu 10 8% 30/06/2026 ²	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.00%	1 000.00	300 000	1 006.79	302 038	1.06%	
Luminor 0.792% 03/12/24	Baa1	Moody's	Eesti	XS2265801238	EUR	5.21%	1 013.49	2 270 225	942.20	2 110 537	7.41%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 550.08	2 413 202	8.48%	
Estonia 4.0% 12/10/2032	AA-	S&P	Eesti	XS2532370231	EUR	4.33%	998.15	1 397 416	976.03	1 366 445	4.80%	
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL ²	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002658	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	100 833.34	201 667	0.71%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.07%	139 180.79	139 181	108 731.82	108 732	0.38%	
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	7.29%	900.65	720 520	740.81	592 650	2.08%	
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iirimaa	XS2307764311	EUR	5.70%	694.02	902 220	668.00	868 395	3.05%	
Siauliu Bankas 1.047% 07/10/25	Baa2	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	5.64%	1 000.03	600 017	905.69	543 413	1.91%	
Siauliu Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.15%	10 000.00	840 000	10 525.70	884 159	3.11%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	2.80%	1 010.36	1 366 011	974.88	1 318 033	4.63%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	2.69%	995.56	901 974	974.16	882 588	3.10%	
Citadele 5% 13/12/2031	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	5.06%	10 000.27	750 020	10 190.72	764 304	2.68%	
Citadele 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	5.43%	996.28	557 914	895.75	501 620	1.76%	
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	4.93%	966.28	821 337	912.59	775 700	2.72%	
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	5.00%	86 925.97	869 260	89 248.75	892 488	3.13%	
France Government 25/02/23	AA	Fitch	Prantsusmaa	FR0013479102	EUR	1.44%	1.00	997 050	1.00	995 387	3.50%	
Eastnine 08/07/24	NR	-	Rootsi	SE0013719788	EUR	9.12%	1 000.01	808 011	963.64	778 625	2.73%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	5.16%	991.64	1 477 549	957.94	1 427 325	5.01%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	5.09%	1 043.46	133 563	936.79	119 909	0.42%	
German Treasury Bill 14/12/2022	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001030443	EUR	1.15%	0.01	900 578	0.01	898 704	3.16%	
German Treasury Bill 18/01/2023	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0001030807	EUR	1.10%	0.01	2 994 776	0.01	2 992 860	10.51%	
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	7.11%	769.77	887 543	684.90	789 689	2.77%	
BP Capital Markets 3.625% PERP	Baa1	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	6.81%	834.48	267 034	868.26	277 843	0.98%	
Apple 1% 10/11/22	Aa1	Moody's	USA	XS1135334800	EUR	2.80%	1 008.70	151 305	1 009.25	151 387	0.53%	
Oodatav krediitkahju (võlainstrumendid)										- 12 397	- 0.04%	

Emitent/väärtpaberi nimetus	Emitendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Keskmine soetushind ühikule (EUR)	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)	Turuväärtus ühikule (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
Aktsiad					668		1 056	0.00%	0.00%
VH Agent 003 osa	Eesti	EE3100005430	EUR	1.24	387	1.75	545	0.00%	
VH Agent 004 osa	Eesti	EE3100005455	EUR	0.97	281	1.77	511	0.00%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.10.2022

Fondi osaku või aktsia nimetus	Fondivalitseja	Fondi päritoluriik	ISIN-kood	Valuuta	Keskmine soetushind ühikule (EUR)	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)	Turuväärtus ühikule (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul		
Fondiosakud						1 659 187		1 742 515	6.12%	6.27%		
Kinnisvarafondid						396 786		443 723	1.56%	1.54%		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	396 786	1.12	443 723	1.56%			
Aktsiafondid						1 262 400		1 298 792	4.56%	4.73%		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	510.82	1 262 400	497.43	1 298 792	4.56%			
Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Lõpp-tähtaeg	Hoiustatud summa (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoiused										954 488	3.35%	4.38%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			954 488	954 488	3.35%	
VARAD KOKKU										28 485 429	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 15 097	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										28 470 332	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 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 instrumendi väärtusele. Aktsiaselts LHV Varahaldus hindab jooksvalt COVID-19 potentsiaalset mõju fondi investeringutele ning täiendava info teatavaks saamisel teostab nõuetekohased ümberhindlused.