

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **31.03.2023**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

14.04.2023

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.03.2023

Emitent/väärtpaberid nimetus	Reiting	Reitingu-agentuur*	Emitendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Tootlus aegumiseni	Keskmine soetushind ühikule (EUR)**	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)**	Turväärtus ühikule (EUR)	Turväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
1. Väärtpaberid							29 016 666	28 592 933		95.80%	96.75%	
Võlainstrumendid							27 399 827	26 738 265		89.59%	90.75%	
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	4.38%	88 854.98	977 405	86 243.21	948 675	3.18%	
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 ²	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 028.13	719 688	2.41%	
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	6.31%	1 000.00	906 000	911.00	825 366	2.77%	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	5.18%	1 007.84	100 784	999.01	99 901	0.33%	
Kodu Kvartal 8.5% 08/07/2025 ²	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 019.36	305 808	1.02%	
Liven Kodu 10 8% 30/06/2026 ²	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.00%	1 000.00	300 000	1 000.00	300 000	1.01%	
Luminor 0.792% 03/12/24	Baa1	Moody's	Eesti	XS2265801238	EUR	6.42%	1 013.49	1 611 455	948.56	1 508 211	5.05%	
Luminor 7.25% 16/01/2026	Baa1	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	7.12%	1 000.03	650 020	1 017.00	661 049	2.21%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 406.97	2 409 767	8.07%	
Estonia 4.0% 12/10/2032	AA-	S&P	Eesti	XS2532370231	EUR	3.74%	998.15	1 397 416	1 039.20	1 454 880	4.87%	
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL ²	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002658	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	100 000.00	200 000	0.67%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.34%	139 180.79	139 181	109 023.18	109 023	0.37%	
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	5.65%	900.65	720 520	824.73	659 784	2.21%	
Volkswagen AG 4.375% PERPETUAL	BBB	Fitch	Holland	XS2342732646	EUR	6.66%	88 345.06	353 380	83 175.86	332 703	1.11%	
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iirimaa	XS2307764311	EUR	4.80%	694.02	902 220	726.23	944 105	3.16%	
Siauli Bankas 1.047% 07/10/25	Baa2	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	6.66%	1 000.03	600 017	912.02	547 212	1.83%	
Siauli Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 165.12	853 870	2.86%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	4.24%	1 010.36	1 366 011	947.35	1 280 821	4.29%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	4.23%	995.56	901 974	962.73	872 230	2.92%	
Citadele 5% 13/12/2031	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	8.44%	10 000.27	750 020	8 148.35	611 126	2.05%	
Citadele 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	5.86%	996.28	557 914	897.39	502 540	1.68%	
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	4.90%	966.28	821 337	931.88	792 098	2.65%	
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	4.95%	1 000.06	350 020	1 005.02	351 757	1.18%	
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	5.20%	86 925.97	869 260	90 469.00	904 690	3.03%	
France Treasury Bill 28/06/2023	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127613463	EUR	2.77%	0.99	1 688 390	0.99	1 688 472	5.66%	
France Government 1.75% 25/05/2023	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011486067	EUR	3.01%	1.01	505 622	1.01	506 476	1.70%	
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	6.19%	807.20	645 758	804.03	643 222	2.16%	
Eastnine 08/07/24	NR	-	Rootsi	SE0013719788	EUR	9.44%	1 000.01	808 011	998.65	806 910	2.70%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	4.22%	991.64	1 477 549	991.86	1 477 872	4.95%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	4.13%	1 043.46	133 563	978.36	125 230	0.42%	
German Treasury Bill 18/10/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030898	EUR	2.91%	0.01	1 771 452	0.01	1 771 236	5.93%	
German Treasury Bill 23/08/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030872	EUR	2.84%	0.01	493 140	0.01	494 365	1.66%	
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	6.93%	769.77	887 543	711.77	820 670	2.75%	
BP Capital Markets 3.625% PERP	Baa1	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	6.88%	834.48	267 034	895.76	286 642	0.96%	
Oodatav krediitkahju (võlainstrumendid)										- 78 135	- 0.26%	
							668	1 216		0.00%	0.00%	
Aktsiad												
VH Agent 003 osa ¹			Eesti	EE3100005430	EUR		1.24	387	2.40	750	0.00%	
VH Agent 004 osa			Eesti	EE3100005455	EUR		0.97	281	1.61	466	0.00%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.03.2023

Fondi osaku või aktsia nimetus	Fondivalitseja	Fondi päritoluriik	ISIN-kood	Valuuta	Keskmine soetushind ühikule (EUR)**	Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)**	Turväärtus ühikule (EUR)	Turväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul		
Fondiosakud						1 616 171		1 853 452	6.21%	6.00%		
Kinnisvarafondid						353 771		436 628	1.46%	1.46%		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	353 771	1.23	436 628	1.46%			
Aktsiafondid						1 262 400		1 416 824	4.75%	4.53%		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	508.62	1 262 400	542.64	1 416 824	4.75%			
Krediitiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Löpp-tähtaeg	Hoiustatud summa (EUR)	Turväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoised										1 269 261	4.25%	3.30%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	Aa3	Moody's	EUR				1 269 261	1 269 261	4.25%	
VARAD KOKKU									29 862 195	100.05%	100.05%	
Fondi kohustused									- 15 802	- 0.05%	- 0.05%	
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS									29 846 393	100.00%	100.00%	

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

** Keskmise soetushinna arvutamisel kasutatakse FIFO meetodit

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

² Reguleeritud turul mittekaubeldavad võlaväärtpaberid