

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **31.05.2023**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

13.06.2023

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



Eve Sirel



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.05.2023

Emitent/väärtpaperi 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							28 102 849	27 862 482	96.50%	92.19%		
Võlainstrumendid							26 486 010	25 971 612	89.95%	86.03%		
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	4.63%	88 854.98	977 405	85 455.66	940 012	3.26%	
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 ²	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 003.13	702 188	2.43%	
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	5.58%	1 000.00	906 000	968.33	877 310	3.04%	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	5.45%	1 007.84	100 784	1 006.69	100 669	0.35%	
Kodu Kvartal 12.5% 08/07/2025 ²	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 006.80	305 488	1.06%	
Liven Kodu 10 8% 30/06/2026 ²	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.00%	1 000.00	300 000	1 013.37	304 011	1.05%	
Luminor 0.792% 03/12/24	Baa1	Moody's	Eesti	XS2265801238	EUR	6.55%	1 013.49	1 611 455	960.88	1 527 806	5.29%	
Luminor 7.25% 16/01/2026	Baa1	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	7.37%	1 000.03	650 020	1 026.82	667 430	2.31%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 679.78	2 416 315	8.37%	
Estonia 4.0% 12/10/2032	AA-	S&P	Eesti	XS2532370231	EUR	3.64%	998.15	1 397 416	1 053.39	1 474 739	5.11%	
Baltic Horizon Fund 08/05/28	NR	-	Eesti	EE3300003235	EUR	11.28%	100 000.00	600 000	100 710.86	604 265	2.09%	
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL ²	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002641	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	101 666.67	203 333	0.70%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.35%	139 180.79	139 181	104 963.19	104 963	0.36%	
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	5.78%	900.65	720 520	827.53	662 025	2.29%	
Volkswagen AG 4.375% PERPETUAL	BBB	Fitch	Holland	XS2342732646	EUR	6.70%	87 534.59	437 673	84 040.03	420 200	1.46%	
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iirimaa	XS2307764311	EUR	5.04%	694.02	902 220	716.64	931 629	3.23%	
Siauli Bankas 1.047% 07/10/25	Baa2	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	7.20%	1 000.03	600 017	913.77	548 262	1.90%	
Siauli Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 267.90	862 504	2.99%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	4.54%	1 010.36	1 366 011	949.10	1 283 182	4.44%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	4.39%	995.56	901 974	967.47	876 527	3.04%	
Citadele banka 5% 13/12/2031	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	6.88%	10 000.27	750 020	9 100.00	682 500	2.36%	
Citadele banka 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	6.28%	996.28	557 914	897.92	502 835	1.74%	
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	5.00%	966.28	821 337	911.72	774 961	2.68%	
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	4.95%	1 000.06	350 020	1 013.30	354 654	1.23%	
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	5.52%	86 925.97	869 260	90 187.67	901 877	3.12%	
France Treasury Bill 28/06/2023	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127613463	EUR	2.57%	0.99	595 902	1.00	598 810	2.07%	
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	6.01%	807.20	645 758	793.68	634 944	2.20%	
Eastnine 08/07/24	NR	-	Rootsi	SE0013719788	EUR	10.11%	1 000.01	808 011	993.91	803 080	2.78%	
Romania 2.875% 28/10/24	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1129788524	EUR	3.96%	991.64	1 477 549	1 002.25	1 493 360	5.17%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	4.07%	1 043.46	133 563	986.19	126 233	0.44%	
German Treasury Bill 18/10/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030898	EUR	3.12%	0.01	1 771 452	0.01	1 778 454	6.16%	
German Treasury Bill 23/08/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030872	EUR	2.98%	0.01	493 140	0.01	496 555	1.72%	
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	6.91%	769.77	887 543	711.90	820 823	2.84%	
BP Capital Markets 3.625% PERP	Baa1	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	6.97%	834.48	267 034	899.32	287 781	1.00%	
Oodatav krediitkahju (võlainstrumendid)										- 98 112	- 0.34%	
Emitent/väärtpaperi 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	1 216	0.00%	0.00%		
VH Agent 003 osa			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 31.05.2023

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						1 616 171		1 889 653	6.54%	6.15%		
Kinnisvarafondid						353 771		439 694	1.52%	1.45%		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	353 771	1.24	439 694	1.52%			
Aktsiafondid						1 262 400		1 449 959	5.02%	4.70%		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	521.38	1 262 400	555.33	1 449 959	5.02%			
Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reifinguagentuur*	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										1 019 336	3.53%	7.84%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	Aa3	Moody's	EUR				1 019 336	1 019 336	3.53%	
3. Muud varad										6 375	0.02%	0.02%
Muud nõuded										6 375	0.02%	
VARAD KOKKU										28 888 192	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 15 284	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										28 872 909	100.00%	100.00%

* Lühendatud reifinguagentuuride 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 mittekabeldavad võlaväärtpaberid

³ Instrumendi väärtus on leitud eeskirja LHV Varahalduse investeerimisfondide vara puhasväärtuse määramise eeskiri punktis 3.3. sätestatud viisil, kuna fondivalitseja hinnangul ei ole võimalik instrumendi hinda kindlaks määrata täpselt ja usaldusväärselt turuhinna/ vastava fondi fondivalitseja avaldatud NAVi alusel.