

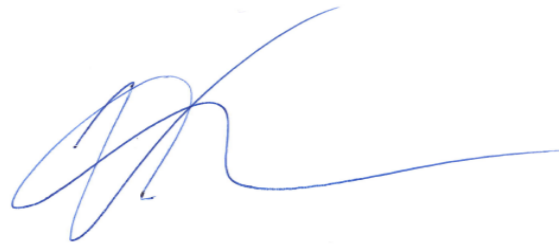
LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **30.06.2023**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

14.07.2023

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



Eve Sirel



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 30.06.2023

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							27 321 448	27 034 000		93.59%	96.50%	
Võlainstrumendid							25 704 609	25 220 698		87.31%	89.95%	
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	4.47%	88 854.98	977 405	85 180.03	936 980	3.24%	
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 ²	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 009.38	706 563	2.45%	
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	6.36%	1 000.00	906 000	910.00	824 460	2.85%	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	5.80%	1 007.84	100 784	1 010.30	101 030	0.35%	
Kodu Kvarital 8.5% 08/07/2025 ²	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 019.60	305 879	1.06%	
Liven Kodu 10 8.5% 30/06/2027 ²	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 000.00	300 000	1.04%	
Luminor 7.75% 08/06/2027	Baa1	Moody's	Eesti	XS2633112565	EUR	7.48%	1 000.01	1 427 020	1 010.15	1 441 482	4.99%	
Luminor 7.25% 16/01/2026	Baa1	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	7.15%	1 000.03	650 020	1 034.77	672 603	2.33%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 000.00	2 400 000	8.31%	
Estonia 4.0% 12/10/2032	AA-	S&P	Eesti	XS2532370231	EUR	3.66%	998.15	1 397 416	1 055.13	1 477 186	5.11%	
Baltic Horizon Fund 08/05/28	NR	-	Eesti	EE3300003235	EUR	11.28%	100 000.00	600 000	101 638.06	609 828	2.11%	
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL ²	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002641	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	100 000.00	200 000	0.69%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.66%	139 180.79	139 181	104 108.29	104 108	0.36%	
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	5.66%	900.65	720 520	835.82	668 653	2.31%	
Volkswagen AG 4.375% PERPETUAL	BBB	Fitch	Holland	XS2342732646	EUR	6.12%	87 534.59	437 673	83 863.63	419 318	1.45%	
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iirimaa	XS2307764311	EUR	4.85%	694.02	902 220	731.19	950 550	3.29%	
Siauli Bankas 1.047% 07/10/25	Baa2	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	7.05%	1 000.03	600 017	917.63	550 578	1.91%	
Siauli Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 318.45	866 750	3.00%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	4.73%	1 010.36	1 366 011	949.70	1 284 001	4.45%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	4.62%	995.56	901 974	968.11	877 106	3.04%	
Citadele banka 5% 13/12/2031 ³	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	6.90%	10 000.27	750 020	8 891.08	666 831	2.31%	
Citadele banka 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	6.51%	996.28	557 914	889.84	498 313	1.73%	
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	5.21%	966.28	821 337	908.70	772 397	2.67%	
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	4.95%	1 000.06	350 020	1 017.37	356 078	1.23%	
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	4.99%	86 925.97	869 260	89 592.59	895 926	3.10%	
France Treasury Bill 29/11/2023	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127462911	EUR	4.14%	0.98	1 476 485	0.98	1 474 170	5.10%	
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	6.00%	807.20	645 758	798.18	638 542	2.21%	
Eastnine 08/07/24	NR	-	Rootsi	SE0013719788	EUR	10.64%	1 000.01	808 011	998.12	806 484	2.79%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	4.26%	1 043.46	133 563	985.38	126 129	0.44%	
German Treasury Bill 18/10/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030898	EUR	3.41%	0.01	1 771 452	0.01	1 781 442	6.17%	
German Treasury Bill 23/08/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030872	EUR	3.22%	0.01	493 140	0.01	497 610	1.72%	
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	7.17%	769.77	887 543	706.10	814 132	2.82%	
BP Capital Markets 3.625% PERP	Baa1	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	6.34%	834.48	267 034	866.09	277 150	0.96%	
Oodatav krediitkahju (võlainstrumendid)										- 81 582	- 0.28%	
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		1 114	0.00%	0.00%
VH Agent 003 osa			Eesti	EE3100005430	EUR		1.24	387	2.23	696	0.00%	
VH Agent 004 osa ¹			Eesti	EE3100005455	EUR		0.97	281	1.44	417	0.00%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 30.06.2023

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		1 812 188	6.27%	6.54%		
Kinnisvarafondid						353 771		441 333	1.53%	1.52%		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	353 771	1.25	441 333	1.53%			
Aktsiafondid						1 262 400		1 370 855	4.75%	5.02%		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	517.97	1 262 400	525.03	1 370 855	4.75%			
Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Lõpp-tähtaeg	Hoiustatud summa (EUR)	Turväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoiused										1 857 270	6.43%	3.53%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	Aa3	Moody's	EUR				1 857 270	1 857 270	6.43%	
3. Muud varad										8 518	0.03%	0.02%
Muud nõuded										8 518	0.03%	
VARAD KOKKU										28 899 787	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 14 788	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										28 884 998	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

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.