

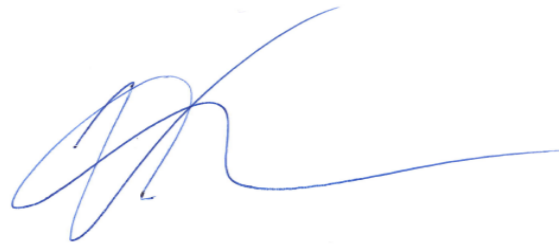
# LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **31.07.2023**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

15.08.2023

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



Eve Sirel



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.07.2023

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
<b>1. Väärtpaberid</b>							<b>28 106 239</b>	<b>28 091 897</b>	<b>96.16%</b>	<b>93.59%</b>		
<b>Võlainstrumendid</b>							<b>26 489 400</b>	<b>26 270 247</b>	<b>89.93%</b>	<b>87.31%</b>		
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	4.38%	88 854.98	977 405	86 627.11	952 898	3.26%	
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 015.83	711 083	2.43%	
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	6.21%	1 000.00	906 000	924.18	837 304	2.87%	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	6.56%	1 007.84	100 784	1 014.15	101 415	0.35%	
Kodu Kvarital 8.5% 08/07/2025 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 005.43	301 629	1.03%	
Liven Kodu 10 8.5% 30/06/2027 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 007.22	302 166	1.03%	
Luminor 7.75% 08/06/2027	Baa1	Moody's	Eesti	XS2633112565	EUR	7.47%	1 000.01	1 427 020	1 027.29	1 465 947	5.02%	
Luminor 7.25% 16/01/2026	Baa1	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	7.08%	1 000.03	650 020	1 043.93	678 555	2.32%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 138.64	2 403 327	8.23%	
Estonia 4.0% 12/10/2032	AA-	S&P	Eesti	XS2532370231	EUR	3.76%	998.15	1 397 416	1 050.00	1 470 000	5.03%	
Baltic Horizon Fund 08/05/28	NR	-	Eesti	EE3300003235	EUR	11.28%	100 000.00	600 000	102 596.18	615 577	2.11%	
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL <sup>2</sup>	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002641	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	100 833.34	201 667	0.69%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.55%	139 180.79	139 181	104 817.02	104 817	0.36%	
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	5.47%	900.65	720 520	846.97	677 579	2.32%	
Volkswagen AG 4.375% PERPETUAL	BBB	Fitch	Holland	XS2342732646	EUR	6.14%	87 534.59	437 673	85 744.19	428 721	1.47%	
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iirimaa	XS2307764311	EUR	4.71%	694.02	902 220	742.86	965 720	3.31%	
Siauli Bankas 1.047% 07/10/25	Baa2	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	6.72%	1 000.03	600 017	928.52	557 112	1.91%	
Siauli Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 370.68	871 138	2.98%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	4.79%	1 010.36	1 366 011	952.56	1 287 855	4.41%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	4.78%	995.56	901 974	970.01	878 831	3.01%	
Citadele banka 5% 13/12/2031 <sup>3</sup>	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	5.82%	10 000.27	750 020	9 581.58	718 619	2.46%	
Citadele banka 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	6.37%	996.28	557 914	898.02	502 894	1.72%	
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	4.95%	966.28	821 337	920.75	782 640	2.68%	
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	4.95%	1 000.06	350 020	1 021.57	357 550	1.22%	
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	4.94%	86 925.97	869 260	91 434.33	914 343	3.13%	
France Treasury Bill 24/01/2024	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127613497	EUR	3.58%	0.98	784 791	0.98	786 128	2.69%	
France Treasury Bill 29/11/2023	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127462911	EUR	3.83%	0.98	1 476 485	0.99	1 480 994	5.07%	
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	5.40%	807.20	645 758	837.29	669 834	2.29%	
Eastnine 08/07/24	NR	-	Rootsi	SE0013719788	EUR	10.08%	1 000.01	808 011	992.52	801 959	2.75%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	4.32%	1 043.46	133 563	987.73	126 429	0.43%	
German Treasury Bill 18/10/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030898	EUR	3.58%	0.01	1 771 452	0.01	1 785 996	6.11%	
German Treasury Bill 23/08/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030872	EUR	3.77%	0.01	493 140	0.01	498 810	1.71%	
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	7.03%	769.77	887 543	715.33	824 776	2.82%	
BP Capital Markets 3.625% PERP	Baa1	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	6.11%	834.48	267 034	886.36	283 636	0.97%	
Oodatav krediitkahju (võlainstrumendid)										- 77 702	- 0.27%	
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
<b>Aksiad</b>							<b>668</b>	<b>1 114</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>		
VH Agent 003 osa			Eesti	EE3100005430	EUR		1.24	387	2.23	696	0.00%	
VH Agent 004 osa			Eesti	EE3100005455	EUR		0.97	281	1.44	417	0.00%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.07.2023

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		
<b>Fondiosakud</b>						<b>1 616 171</b>		<b>1 820 537</b>	<b>6.23%</b>	<b>6.27%</b>		
<b>Kinnisvarafondid</b>						<b>353 771</b>		<b>429 397</b>	<b>1.47%</b>	<b>1.53%</b>		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	353 771	1.21	429 397	1.47%			
<b>Aktsiafondid</b>						<b>1 262 400</b>		<b>1 391 140</b>	<b>4.76%</b>	<b>4.75%</b>		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	527.07	1 262 400	532.80	1 391 140	4.76%			
Krediidiasutuse 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
<b>2. Hoised</b>										<b>1 136 039</b>	<b>3.89%</b>	<b>6.43%</b>
<b>Arvelduskontod</b>												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	Aa3	Moody's	EUR				1 136 039	1 136 039	3.89%	
<b>3. Muud varad</b>										<b>0</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.03%</b>
<b>VARAD KOKKU</b>										<b>29 227 937</b>	<b>100.05%</b>	<b>100.05%</b>
Fondi kohustused										- 15 404	- 0.05%	- 0.05%
<b>FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS</b>										<b>29 212 532</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.00%</b>

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

\*\* Keskmise soetushinna arvutamisel kasutatakse FIFO meetodit

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

<sup>2</sup> Reguleeritud turul mittekaubeldavad võlaväärtpaberid

<sup>3</sup> 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.