

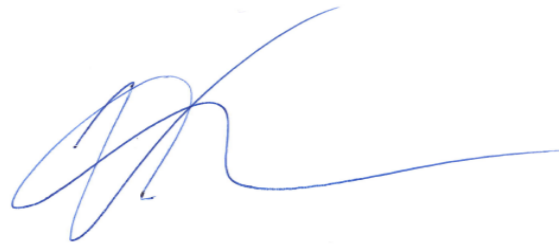
LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **31.08.2023**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

15.09.2023

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



Eve Sirel



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.08.2023

Emitent/väärtpaberi 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							27 505 956	27 602 984		93.95%	96.16%	
Võlainstrumendid							25 889 117	25 769 403		87.71%	89.93%	
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	4.34%	88 854.98	977 405	87 180.19	958 982	3.26%	
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 ²	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 022.29	715 604	2.44%	
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	6.31%	1 000.00	906 000	922.33	835 634	2.84%	
Eesti Energia 2.384% 22/09/23	BBB-	S&P	Eesti	XS1292352843	EUR	10.50%	1 007.84	100 784	1 017.40	101 740	0.35%	
Kodu Kvarital 8.5% 08/07/2025 ²	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 012.75	303 825	1.03%	
Liven Kodu 10 8.5% 30/06/2027 ²	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 014.44	304 332	1.04%	
Luminor 7.75% 08/06/2027	Baa1	Moody's	Eesti	XS2633112565	EUR	6.96%	1 000.01	1 427 020	1 042.79	1 488 057	5.06%	
Luminor 7.25% 16/01/2026	Baa1	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	6.77%	1 000.03	650 020	1 053.09	684 508	2.33%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 277.28	2 406 655	8.19%	
Estonia 4.0% 12/10/2032	AA-	S&P	Eesti	XS2532370231	EUR	3.70%	998.15	1 397 416	1 058.40	1 481 756	5.04%	
Baltic Horizon Fund 08/05/28	NR	-	Eesti	EE3300003235	EUR	11.74%	100 000.00	492 857	100 739.99	496 504	1.69%	
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL ²	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002641	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	101 666.67	203 333	0.69%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.51%	139 180.79	139 181	105 286.76	105 287	0.36%	
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	5.83%	900.65	720 520	821.90	657 518	2.24%	
Volkswagen AG 4.375% PERPETUAL	BBB	Fitch	Holland	XS2342732646	EUR	6.38%	87 534.59	437 673	83 614.75	418 074	1.42%	
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iirimaa	XS2307764311	EUR	4.92%	694.02	902 220	732.81	952 653	3.24%	
Siauli Bankas 1.047% 07/10/25	Baa2	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	6.32%	1 000.03	600 017	939.41	563 645	1.92%	
Siauli Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 422.92	875 525	2.98%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	4.75%	1 010.36	1 366 011	956.92	1 293 752	4.40%	
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	4.69%	995.56	901 974	974.83	883 192	3.01%	
Citadele banka 5% 13/12/2031 ³	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	6.09%	10 000.27	750 020	9 459.28	709 446	2.41%	
Citadele banka 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	6.54%	996.28	557 914	897.55	502 631	1.71%	
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	5.17%	966.28	821 337	917.80	780 132	2.66%	
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	4.95%	1 000.06	350 020	1 025.78	359 022	1.22%	
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	5.03%	86 925.97	869 260	91 249.08	912 491	3.11%	
France Treasury Bill 24/01/2024	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127613497	EUR	3.70%	0.98	784 791	0.99	788 155	2.68%	
France Treasury Bill 29/11/2023	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127462911	EUR	4.57%	0.98	1 476 485	0.99	1 483 065	5.05%	
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	5.30%	807.20	645 758	847.08	677 662	2.31%	
Eastnine 08/07/24	NR	-	Rootsi	SE0013719788	EUR	9.37%	1 000.01	808 011	1 007.44	814 011	2.77%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	4.27%	1 043.46	133 563	992.29	127 014	0.43%	
German Treasury Bill 18/10/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030898	EUR	3.54%	0.01	1 771 452	0.01	1 791 594	6.10%	
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	6.94%	769.77	887 543	722.94	833 551	2.84%	
BP Capital Markets 3.625% PERP	Baa1	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	6.20%	834.48	267 034	882.73	282 475	0.96%	
Oodatav krediitkahju (võlainstrumendid)										- 22 422	- 0.08%	

Emitent/väärtpaberi nimetus	Emitendi riik	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
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	Eesti	EE3100005455	EUR	0.97	281	1.44	417	0.00%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.08.2023

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		1 832 467	6.24%	6.23%		
Kinnisvarafondid						353 771		430 798	1.47%	1.47%		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	353 771	1.22	430 798	1.47%			
Aktsiafondid						1 262 400		1 401 669	4.77%	4.76%		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	529.00	1 262 400	536.83	1 401 669	4.77%			
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										1 793 653	6.10%	3.89%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	Aa3	Moody's	EUR				1 793 653	1 793 653	6.10%	
VARAD KOKKU								29 396 636	100.05%	100.05%		
Fondi kohustused								- 15 518	- 0.05%	- 0.05%		
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS								29 381 119	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.