

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga 30.09.2023

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

13.10.2023

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



Eve Sirel



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 30.09.2023

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 puhastväärtusest	Osakaal fondi varade puhastväärtusest eelneval kuul	
1. Väärtpaberid							27 405 172	27 393 910			98.44%	93.95%	
Võlainstrumentid							25 788 333	25 588 949				91.95%	87.71%
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	4.85%	88 854.98	977 405	86 880.56	955 686	3.43%		
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 ²	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 028.54	719 979	2.59%		
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	7.58%	1 000.00	906 000	840.00	761 040	2.73%		
Kodu Kvarital 8.5% 08/07/2025 ²	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 019.83	305 950	1.10%		
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	1.08%		
Luminor 7.75% 08/06/2027	Baa1	Moody's	Eesti	XS2633112565	EUR	7.16%	1 000.01	1 427 020	1 049.14	1 497 122	5.38%		
Luminor 7.25% 16/01/2026	Baa1	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	6.98%	1 000.03	650 020	1 063.56	691 313	2.48%		
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 411.44	2 409 875	8.66%		
Estonia 4.0% 12/10/2032	AA-	S&P	Eesti	XS2532370231	EUR	4.01%	998.15	1 397 416	1 038.24	1 453 543	5.22%		
Baltic Horizon Fund 08/05/28	NR	-	Eesti	EE3300003235	EUR	11.74%	100 000.00	492 857	101 705.17	501 261	1.80%		
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL ²	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002641	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	100 000.00	200 000	0.72%		
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.74%	139 180.79	139 181	104 793.86	104 794	0.38%		
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	6.17%	900.65	720 520	813.34	650 671	2.34%		
Volkswagen AG 4.375% PERPETUAL	BBB	Fitch	Holland	XS2342732646	EUR	7.24%	87 534.59	437 673	83 133.36	415 667	1.49%		
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iriramaa	XS2307764311	EUR	5.03%	694.02	902 220	729.01	947 719	3.41%		
Siauliu Bankas 1.047% 07/10/25	Baa2	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	7.05%	1 000.03	600 017	940.27	564 162	2.03%		
Siauliu Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 473.47	879 771	3.16%		
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	4.95%	1 010.36	1 366 011	957.92	1 295 111	4.65%		
ALTUMG 1.3% 17/10/24	Baa1	Moody's	Läti	LV0000802353	EUR	4.94%	995.56	901 974	976.07	884 324	3.18%		
Citadele banka 5% 13/12/2031 ³	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	5.91%	10 000.27	750 020	9 614.66	721 100	2.59%		
Citadele banka 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	6.91%	996.28	557 914	903.89	506 179	1.82%		
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	5.39%	966.28	821 337	914.79	777 568	2.79%		
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	5.14%	1 000.06	350 020	1 020.90	357 314	1.28%		
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	5.34%	86 925.97	869 260	91 264.00	912 640	3.28%		
France Treasury Bill 24/01/2024	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127613497	EUR	4.53%	0.98	784 791	0.99	788 480	2.83%		
France Treasury Bill 29/11/2023	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0127462911	EUR	4.96%	0.98	1 476 485	0.99	1 487 655	5.35%		
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	5.71%	807.20	645 758	826.80	661 443	2.38%		
Eastnine 08/07/24	NR	-	Rootsi	SE0013719788	EUR	10.30%	1 000.01	808 011	1 009.62	815 770	2.93%		
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	4.58%	1 043.46	133 563	989.70	126 681	0.46%		
German Treasury Bill 18/10/23	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001030898	EUR	3.81%	0.01	1 771 452	0.01	1 796 634	6.46%		
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	6.85%	769.77	887 543	730.07	841 769	3.02%		
BP Capital Markets 3.625% PERP	Baa1	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	7.06%	834.48	267 034	875.60	280 193	1.01%		
Oodatav krediidikahju (võlainstrumentid)										- 22 463	- 0.08%		

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 puhastväärtusest	Osakaal fondi varade puhastväärtusest eelneval kuul	
Aktsiad					668	1 255			0.00%	0.00%
VH Agent 003 osa	Eesti	EE3100005430	EUR	1.24	387	2.08	650	0.00%		
VH Agent 004 osa ¹	Eesti	EE3100005455	EUR	0.97	281	2.10	606	0.00%		

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 30.09.2023

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		1 803 705	6.48%	6.24%		
Kinnisvarafondid						353 771		432 721	1.55%	1.47%		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	353 771	1.22	432 721	1.55%			
Aktsiafondid						1 262 400		1 370 984	4.93%	4.77%		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	524.35	1 262 400	525.08	1 370 984	4.93%			
Krediidiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intress	Algus-kuupäev	Löpp-tähtaeg	Hoiustatud summa (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoiused										448 571	1.61%	6.10%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	Aa3	Moody's	EUR				448 571	448 571	1.61%	
VARAD KOKKU									27 842 481	100.05%	100.05%	
Fondi kohustused									- 14 308	- 0.05%	- 0.05%	
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS									27 828 173	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