

# LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **29.02.2024**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

14.03.2024

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



Eve Sirel



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 29.02.2024

Emilent/väärtpaberi nimetus	Reiting	Reitingu-agentuur*	Emilendi 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	
<b>1. Väärtpaberid</b>							<b>25 928 597</b>	<b>26 616 122</b>	<b>95.94%</b>	<b>96.36%</b>			
<b>Võlainstrumentid</b>							<b>24 311 758</b>	<b>24 711 376</b>	<b>89.08%</b>	<b>89.45%</b>			
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	3.97%	88 854.98	977 405	90 521.44	995 736	3.59%		
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 021.88	715 313	2.58%		
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	5.91%	1 000.00	906 000	958.19	868 124	3.13%		
Kodu Kvarital 8.5% 08/07/2025 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 012.28	303 683	1.09%		
Liven Kodu 10 8.5% 30/06/2027 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 013.97	304 192	1.10%		
Luminor 7.75% 08/06/2027	A3	Moody's	Eesti	XS2633112565	EUR	5.87%	1 000.01	1 427 020	1 117.33	1 594 423	5.75%		
Luminor 7.25% 16/01/2026	A3	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	6.66%	1 000.03	650 020	1 026.12	666 975	2.40%		
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 <sup>2</sup>	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 272.81	2 406 547	8.67%		
Baltic Horizon Fund 08/05/28	NR	-	Eesti	EE3300003235	EUR	11.93%	100 000.00	492 857	100 686.52	496 241	1.79%		
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL <sup>2</sup>	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002641	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	101 638.89	203 278	0.73%		
Banco Santander 4.625% 04/05/27	Aa1	Moody's	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.25%	139 180.79	139 181	107 897.62	107 898	0.39%		
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	4.69%	900.65	720 520	885.41	708 328	2.55%		
Volkswagen AG 4.375% PERPETUAL	BBB	Fitch	Holland	XS2342732646	EUR	6.15%	87 534.59	437 673	93 145.30	465 727	1.68%		
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iirimaa	XS2307764311	EUR	3.99%	694.02	902 220	808.34	1 050 837	3.79%		
Siauliu Bankas 1.047% 07/10/25	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	6.22%	1 000.03	600 017	964.15	578 489	2.09%		
Siauliu Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.15%	10 000.00	840 000	10 114.26	849 598	3.06%		
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	5.44%	1 010.36	1 366 011	972.75	1 315 160	4.74%		
Citadele banka 5% 13/12/2031	Baa2	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	6.96%	10 000.27	750 020	9 006.56	675 492	2.43%		
Citadele banka 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	7.28%	996.28	557 914	904.40	506 461	1.83%		
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	4.84%	966.28	821 337	949.84	807 362	2.91%		
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	4.74%	1 000.06	350 020	1 010.14	353 548	1.27%		
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	4.52%	86 925.97	869 260	96 263.25	962 633	3.47%		
France Treasury Bill 30/10/2024	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0128071067	EUR	3.64%	0.97	1 557 650	0.98	1 561 456	5.63%		
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	4.69%	807.20	645 758	905.81	724 651	2.61%		
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	4.05%	1 043.46	133 563	988.50	126 528	0.46%		
German Treasury Bill 16/10/2024	AAA	S&P	Saksamaa	DE000BU0E105	EUR	3.57%	0.01	1 754 961	0.01	1 759 878	6.34%		
German Treasury Bill 19/06/24	AAA	S&P	Saksamaa	DE000BU0E063	EUR	3.57%	0.01	1 365 680	0.01	1 384 726	4.99%		
German Treasury Bill 1% 15/08/2024	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001102366	EUR	3.66%	0.01	985 264	0.01	993 350	3.58%		
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	4.97%	769.77	887 543	821.44	947 123	3.41%		
BP Capital Markets 3.625% PERP	Baa1	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	6.19%	834.48	267 034	954.86	305 555	1.10%		
Oodatav krediidikahju (võlainstrumentid)										- 27 934	- 0.10%		
							<b>Keskmine soetushind ühikule (EUR)**</b>	<b>Keskmine soetusväärtus kokku (EUR)**</b>	<b>Turuväärtus ühikule (EUR)</b>	<b>Turuväärtus kokku (EUR)</b>	<b>Osakaal fondi varade puhastväärtusest</b>	<b>Osakaal fondi varade puhastväärtusest eelneval kuul</b>	
<b>Aktsiad</b>							<b>668</b>	<b>1 300</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>			
VH Agent 003 osa			Eesti	EE3100005430	EUR		1.24	387	2.54	793	0.00%		
VH Agent 004 osa			Eesti	EE3100005455	EUR		0.97	281	1.76	507	0.00%		

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 29.02.2024

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		
<b>Fondiosakud</b>						<b>1 616 171</b>		<b>1 903 446</b>	<b>6.86%</b>	<b>6.90%</b>		
<b>Kinnisvarafondid</b>						<b>353 771</b>		<b>428 973</b>	<b>1.55%</b>	<b>1.55%</b>		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	353 771	1.21	428 973	1.55%			
<b>Aktsiafondid</b>						<b>1 262 400</b>		<b>1 474 473</b>	<b>5.31%</b>	<b>5.35%</b>		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	531.77	1 262 400	564.72	1 474 473	5.31%			
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
<b>2. Hoiused</b>										<b>1 139 442</b>	<b>4.11%</b>	<b>3.69%</b>
<b>Arvelduskontod</b>												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	Aa3	Moody's	EUR				1 139 442	1 139 442	4.11%	
<b>VARAD KOKKU</b>									<b>27 755 563</b>	<b>100.05%</b>	<b>100.05%</b>	
Fondi kohustused									- 13 381	- 0.05%	- 0.05%	
<b>FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS</b>									<b>27 742 182</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