

LHV Pensionifond XL

Investeeringute aruanne seisuga

30.09.2022

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

14.10.2022

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



LHV Pensionifond XL investeringute aruanne seisuga 30.09.2022

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							160 182 647	177 658 481	93.19%	92.47%		
Võlainstrumendid							40 587 178	40 556 620	21.27%	26.45%		
Baltic Horizon Fund 4.25% 08/05/23	BB+	S&P	Eesti	EE3300111467	EUR	7.88%	1 000.82	3 062 522	986.14	3 017 585	1.58%	
BIGBANK 6.5% 28/12/2027 ²	NR	-	Eesti	EE3300111400	EUR	6.50%	1 000.00	2 000 000	1 016.97	2 033 944	1.07%	
BIGBANK 6.5% 30/12/2031 ²	NR	-	Eesti	EE3300002526	EUR	6.50%	1 000.00	2 000 000	1 016.61	2 033 222	1.07%	
Ekspress Grupp 6.0% 07/10/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300001528	EUR	6.00%	1 000.00	785 000	1 059.67	831 838	0.44%	
INBANK 6% 19/12/29	NR	-	Eesti	EE3300001544	EUR	7.36%	1 000.08	40 003	935.24	37 410	0.02%	
Sunly 8% 17/11/2025 ²	NR	-	Eesti	EE3300001841	EUR	7.99%	1 013.76	1 182 040	1 030.22	1 201 239	0.63%	
Aiandi Kodud omanikulaen	NR	-	Eesti		EUR	5.00%	1.00	1 750 000	1.00	1 750 000	0.92%	
Akadeemia15b omanikulaen	NR	-	Eesti		EUR	5.00%	1.00	304 884	1.00	305 265	0.16%	
Kesk Tee Jyri omanikulaen	NR	-	Eesti		EUR	4.30%	1.00	397 200	1.00	398 671	0.21%	
Manufaktuuri omanikulaen	NR	-	Eesti		EUR	5.00%	1.00	760 000	1.00	760 950	0.40%	
Marati Maja omanikulaen	NR	-	Eesti		EUR	5.00%	1.00	600 000	1.00	601 417	0.32%	
Sopruse157 omanikulaen	NR	-	Eesti		EUR	5.00%	1.00	297 500	1.00	298 078	0.16%	
Taevakivi omanikulaen	NR	-	Eesti		EUR	6.30%	1.00	234 000	1.01	235 474	0.12%	
Siauliu Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	2 950 000	10 473.47	3 089 672	1.62%	
Citadele banka 5.5% 24/11/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000880011	EUR	5.57%	10 000.08	2 550 020	10 192.05	2 598 973	1.36%	
Mafisa52 omanikulaen	NR	-	Läti		EUR	5.50%	1.00	510 000	1.01	513 117	0.27%	
France Government 2.25% 25/10/22	Aa2	Moody's	Prantsusmaa	FR0011337880	EUR	0.92%	1.03	19 443 997	1.02	19 312 188	10.13%	
Eastnine 08/07/24	NR	-	Rootsi	SE0013719788	EUR	8.75%	1 000.01	1 720 011	969.17	1 666 967	0.87%	
Oodatav krediidikahju (võlainstrumendid)										- 129 390	- 0.07%	

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							44 657 598	48 067 091	25.21%	25.19%
Valaris	Bermuda	BMG9460G1015	USD	29.99	1 012 638	50.21	2 071 315	1.09%		
LC15 osa	Eesti	EE3100002734	EUR	1.00	156 484	1.57	246 384	0.13%		
Ekspress Grupp ¹	Eesti	EE3100016965	EUR	1.24	592 394	1.42	679 521	0.36%		
EFTEN Balti Kinnisvaraportfell	Eesti	EE3100017138	EUR	2.13	99 995	1.12	52 795	0.03%		
VH KV 002 osa	Eesti	EE3100019811	EUR	294.50	176 700	535.21	321 129	0.17%		
Lumi Kodud Aiandi osa	Eesti	EE3100143843	EUR	1.00	702 500	2.27	1 597 134	0.84%		
Lumi Kodud Manufaktuuri OÜ	Eesti	EE3100136789	EUR	0.00	0	3.81	1 349 082	0.71%		
Sopruse pst 157	Eesti	EE3100096264	EUR	200.50	170 425	205.25	174 460	0.09%		
VH KV 003 osa	Eesti	EE3100079989	EUR	260.00	156 000	317.94	190 761	0.10%		
Tallink Grupp	Eesti	EE3100004466	EUR	0.60	1 091 502	0.47	849 603	0.45%		
Tallinna Kaubamaja	Eesti	EE0000001105	EUR	5.24	881 227	9.67	1 626 339	0.85%		
Tallinna Sadam	Eesti	EE3100021635	EUR	1.70	1 717 513	1.39	1 400 279	0.73%		
VH KV 001 osa	Eesti	EE3100003930	EUR	1.00	309 052	1.56	480 916	0.25%		
VH Agent 002 osa	Eesti	EE3100003948	EUR	1.00	393	1.34	525	0.00%		
VH Agent 008 osa	Eesti	EE3100020660	EUR	1.00	223	1.62	362	0.00%		
Aena SME ¹	Hispaania	ES0105046009	EUR	146.71	1 275 789	106.90	929 602	0.49%		
Glencore	Jersey	JE00B4T3BW64	GBP	4.71	1 305 447	5.42	1 436 486	0.75%		
Yellow Cake	Jersey	JE00BF50RG45	GBP	3.53	2 267 455	4.60	2 854 157	1.50%		
Tencent Holdings ¹	Kaimanisaared	KYG875721634	HKD	62.69	805 925	34.81	522 210	0.27%		
Agnico Eagle Mines	Kanada	CA0084741085	USD	49.59	2 610 772	43.32	2 524 053	1.32%		
Barrick Gold Corp	Kanada	CA0679011084	USD	17.77	3 314 766	15.90	3 298 345	1.73%		
Pan American Silver	Kanada	CA6979001089	USD	28.99	1 905 153	16.29	1 312 772	0.69%		
Apranga	Leedu	LT0000102337	EUR	1.59	145 138	1.79	163 268	0.09%		
Novaturas ¹	Leedu	LT0000131872	EUR	10.50	1 010 625	2.61	251 213	0.13%		

LHV Pensionifond XL investeringute aruanne seisuga 30.09.2022

Emitent/väärtpaberri 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
Siauliu Bankas	Leedu	LT0000102253	EUR	0.16	176 232	0.53	590 557	0.31%	
Silver Screen Holdings	Leedu	LT0000132581	EUR	0.50	1 072 428	0.44	952 531	0.50%	
Mobility Technology Opportunities	Luksemburg		EUR	0.78	832 677	0.76	815 584	0.43%	
AngloGold Ashanti	Lõuna-Aafrika	US0351282068	USD	26.05	1 586 499	14.18	996 307	0.52%	
Matisa 52 osa	Läti		EUR	250.50	210 420	234.53	197 009	0.10%	
Equinor	Norra	NO0010096985	NOK	17.49	715 606	33.83	1 326 017	0.70%	
Thales	Prantsusmaa	FR0000121329	EUR	103.86	798 898	113.00	869 196	0.46%	
Epiroc	Rootsi	SE0015658109	SEK	14.29	1 225 814	14.69	1 249 397	0.66%	
Siemens Healthineers	Saksamaa	DE000SHL1006	EUR	31.99	836 010	44.28	1 157 346	0.61%	
Volkswagen ¹	Saksamaa	DE0007664039	EUR	135.48	508 054	126.40	474 000	0.25%	
Fortum ¹	Soome	FI0009007132	EUR	23.95	1 334 634	13.77	767 278	0.40%	
Huhtamaki	Soome	FI0009000459	EUR	28.22	403 107	32.66	466 581	0.24%	
Metso Outotec ¹	Soome	FI0009014575	EUR	5.89	636 832	6.86	740 907	0.39%	
Ponsse	Soome	FI0009005078	EUR	20.78	347 683	24.70	413 355	0.22%	
Stora Enso ¹	Soome	FI0009005961	EUR	11.25	404 908	13.09	471 240	0.25%	
UPM-Kymmene	Soome	FI0009005987	EUR	24.17	1 599 709	32.58	2 156 210	1.13%	
Valmet ¹	Soome	FI4000074984	EUR	11.81	75 516	20.83	133 187	0.07%	
Wartsila ¹	Soome	FI0009003727	EUR	5.20	342 917	6.58	433 793	0.23%	
Bank North ³	Suurbritannia		GBP	0.18	323 479	0.06	98 123	0.05%	
Roche Holding	Šveits	CH0012032048	CHF	256.09	557 027	338.30	845 754	0.44%	
Carlsberg	Taani	DK0010181759	DKK	99.56	409 851	120.19	497 230	0.26%	
DSV PANALPINA ¹	Taani	DK0060079531	DKK	163.57	1 029 234	120.49	758 344	0.40%	
GN Store Nord A/S ¹	Taani	DK0010272632	DKK	48.32	1 828 296	18.03	682 447	0.36%	
Rockwool	Taani	DK0010219153	DKK	160.50	961 180	161.77	968 838	0.51%	
Antero Resources Corp ¹	USA	US03674X1063	USD	33.73	949 557	31.32	956 239	0.50%	
Freeport-McMoRan	USA	US35671D8570	USD	13.52	770 790	28.04	1 803 842	0.95%	
Range Resources Corp ¹	USA	US75281A1097	USD	27.44	1 168 359	25.91	1 195 367	0.63%	
Stryker Corporation	USA	US8636671013	USD	151.32	413 279	207.78	649 508	0.34%	
Take-Two Interactive Software ¹	USA	US8740541094	USD	110.02	984 347	111.82	1 068 196	0.56%	
Bank Saint Petersburg ³	Venemaa	RU0009100945	RUB	0.90	446 143	0.00	0	0.00%	

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						74 937 871		89 702 948	47.05%	41.14%
Kinnisvarafondid						17 067 426		22 707 885	11.91%	11.64%
EFTEN Real Estate Fund III	EFTEN Capital	Eesti	EE3100127242	EUR	17.83	2 086	19.70	2 305	0.00%	
EFTEN Kinnisvarafond	EFTEN Capital	Eesti	EE3100097411	EUR	1.87	2 762 507	3.07	4 545 416	2.38%	
EFTEN Kinnisvarafond II	EFTEN Capital	Eesti	EE3100125238	EUR	10.57	205 572	16.02	311 471	0.16%	
Birdeye Timber Fund	Birdeye Capital	Eesti	EE3500110186	EUR	10.18	735 916	18.88	1 364 333	0.72%	
Birdeye Timber Fund 2	Birdeye Capital	Eesti	EE3500110269	EUR	10.21	950 767	14.26	1 328 258	0.70%	
Birdeye Timber Fund 3	Birdeye Capital	Eesti	EE3600001756	EUR	9.98	699 150	10.88	761 706	0.40%	
Usaldusfond EFTEN Real Estate Fund 4	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	4 118 765	1.25	5 141 153	2.70%	
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	396 786	1.11	439 006	0.23%	
EFTEN Residential Fund usaldusfond	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	395 910	1.19	470 736	0.25%	
Lords LB Baltic Green Fund (V)	Lords LB Asset Management	Leedu	-	EUR	1.00	835 772	1.03	861 939	0.45%	
East Capital Baltic Property Fund II	East Capital (Lux) General Partner	Luksemburg	LU0758647282	EUR	134.42	33 550	199.15	49 706	0.03%	
East Capital Baltic Property Fund III	East Capital (Lux) General Partner	Luksemburg	LU1274822847	EUR	118.92	3 912 351	149.61	4 921 825	2.58%	
East Capital Real Estate Fund IV	East Capital (Lux) General Partner	Luksemburg	LU2008658630	EUR	104.83	819 314	113.85	889 803	0.47%	
SG Capital Partners Fund 1	SG Capital Partners	Läti	-	EUR	1.00	1 198 982	1.35	1 620 229	0.85%	

LHV Pensionifond XL investeringute aruanne seisuga 30.09.2022

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
Aktsiafondid						31 096 984		30 695 238	16.10%	10.89%
iShares Gold Producers UCITS ETF	BlackRock Asset Management Ireland Limit	Iirimaa	IE00B6R52036	EUR	9.73	6 049 364	10.69	6 647 245	3.49%	
Lyxor EURO STOXX Banks DR UCITS	Lyxor Asset Management	Luksemburg	LU1829219390	EUR	94.30	10 210 234	80.33	8 697 839	4.56%	
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondslleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	532.28	7 871 329	516.89	8 533 879	4.48%	
Global X Copper Miners ETF	Global X	USA	US37954Y8306	USD	32.55	3 189 711	28.99	3 038 414	1.59%	
VanEck Oil Services ETF	Van Eck Associates	USA	US92189H6071	USD	217.16	1 915 991	216.67	1 911 680	1.00%	
Energy Select Sector SPDR Fund	State Street Global Advisors	USA	US81369Y5069	USD	73.65	1 860 355	73.88	1 866 181	0.98%	
Erakapitalfondid						26 773 461		36 299 825	19.04%	18.61%
Usaldusfond BaltCap Private Equity Fund III	BaltCap Private Equity Management III	Eesti	-	EUR	1.00	481 746	1.10	527 984	0.28%	
Usaldusfond BaltCap Infrastructure Fund	BaltCap Infrastructure Management	Eesti	-	EUR	1.00	335 354	1.30	437 433	0.23%	
BPEF III Supplementary Investment Facility UF	BaltCap Private Equity Management III	Eesti	-	EUR	1.00	320 409	1.00	319 958	0.17%	
Usaldusfond Equity United PE I	Equity United GP1	Eesti	-	EUR	1.00	1 029 305	1.05	1 076 080	0.56%	
Usaldusfond Superangel One	Superangel1 GP	Eesti	-	EUR	1.00	735 654	2.42	1 777 937	0.93%	
Specialist VC II	Specialist Fund Management	Eesti	-	EUR	1.00	124 887	0.91	114 108	0.06%	
Tera Ventures II Usaldusfond	Tera Ventures GP II	Eesti	-	EUR	1.00	200 113	0.94	189 021	0.10%	
Usaldusfond Trind Ventures Fund I	Trind Ventures	Eesti	EE3500110285	EUR	1.00	814 729	1.58	1 286 003	0.67%	
BaltCap Lithuania SME Fund KUB	BaltCap	Leedu	-	EUR	1.00	114 558	2.96	338 845	0.18%	
INVL Baltic Sea Growth Fund	INVL Asset Management	Leedu	-	EUR	1.00	593 799	1.46	868 879	0.46%	
KJK Fund III	KJK Fund III Management	Luksemburg	LU1840779810	EUR	1 000.00	1 840 000	1 146.83	2 110 167	1.11%	
KJK Fund II Balkan AI July 2012 ¹	KJK Management	Luksemburg	LU0802715499	EUR	1 001.84	153 271	3 887.78	594 788	0.31%	
KJK Fund II Balkan AI Sep 2012 ¹	KJK Management	Luksemburg	LU0871721717	EUR	1 001.84	152 960	3 878.36	592 144	0.31%	
KJK Fund II Balkan Discovery A June 2014	KJK Management	Luksemburg	LU1088021974	EUR	1 000.00	328 258	3 646.44	1 196 973	0.63%	
KJK Fund II Balkan Discovery A June 2015	KJK Management	Luksemburg	LU1246890583	EUR	1 027.29	196 955	3 593.87	689 028	0.36%	
KJK Fund II Balkan Discovery A December 2015	KJK Management	Luksemburg	LU1367089452	EUR	1 173.84	196 954	3 457.76	580 164	0.30%	
KJK Fund II Balkan Discovery A May 2016	KJK Management	Luksemburg	LU1448083474	EUR	1 286.51	196 954	3 650.63	558 882	0.29%	
KJK Fund II Balkan Discovery A December 2016	KJK Management	Luksemburg	LU1570390598	EUR	1 489.59	196 955	3 611.66	477 537	0.25%	
KJK Fund II Balkan Discovery A November 2017	KJK Management	Luksemburg	LU1780616741	EUR	1 802.24	196 955	3 165.17	345 899	0.18%	
Astorg Mid-Cap I	Astorg Mid-Cap I (GP) S.a r.l.	Luksemburg	-	EUR	1.00	720 000	0.77	556 619	0.29%	
BaltCap Private Equity Fund II	BaltCap Private Equity Management II	Luksemburg	-	EUR	1.00	204 901	2.33	477 426	0.25%	
BPM Mezzanine Fund	BPM Mezzanine Fund GP	Luksemburg	LU2870209652	EUR	1.00	568 475	1.43	812 686	0.43%	
Karma Ventures I	Karma Ventures	Luksemburg	-	EUR	1.00	623 776	1.65	1 031 788	0.54%	
Karma Ventures II	Karma Ventures II GP	Luksemburg	-	EUR	1.00	222 221	0.90	200 561	0.11%	
NOAL	BRG NOAL GP	Luksemburg	-	EUR	1.00	3 285 847	0.64	2 091 087	1.10%	
Plural 2022	Plural Platform S.a r.l.	Luksemburg	-	EUR	1.00	600 000	1.08	646 151	0.34%	
Monte Rosa V Class J	Pictet Alternative Advisors	Luksemburg	-	USD	1.03	3 719 329	1.32	4 803 641	2.52%	
BaltCap Latvia Venture Capital Fund AIF KS	BaltCap AIFP	Läti	-	EUR	1.00	66 940	0.81	54 061	0.03%	
Livonia Partners Fund I	Livonia Partners	Läti	-	EUR	1.00	1 698 881	1.89	3 216 253	1.69%	
Investindustrial VII L.P.	Investindustrial VII GP	Suurbritannia	-	EUR	1.00	2 552 187	1.11	2 835 773	1.49%	
Axcel VI	Axcel VI GP ApS	Taani	-	EUR	1.00	4 301 089	1.28	5 491 948	2.88%	

Tuletisinstrumenti nimetus	Liik	Väljaandja	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Löpp-tähtaeg	Turväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
Tuletisinstrumentid							- 668 179	- 0.35%	- 0.32%
USD Forward	Forward	SEB Pank	A+	S&P	EUR	09.03.2023	- 668 179	- 0.35%	

LHV Pensionifond XL investeringute aruanne seisuga 30.09.2022

Krediitiasutuse 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. Hoised										12 541 288	6.58%	7.55%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto CHF, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	CHF	0.00%			85	85	0.00%	
Arvelduskonto DKK, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	DKK	0.00%			13	13	0.00%	
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	EUR	0.00%			14 034 926	14 034 926	7.36%	
Arvelduskonto GBP, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	GBP	0.00%			83 015	83 015	0.04%	
Arvelduskonto HKD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	HKD	0.00%			3 136	3 136	0.00%	
Arvelduskonto NOK, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	NOK	0.00%			33 146	33 146	0.02%	
Arvelduskonto USD, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	A+	S&P	USD	0.00%			-3 773 046	-3 773 046	-1.98%	
Tähtajalised hoised												
SEB Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	A+	S & P	EUR	0.00%	09.09.2022	09.03.2023	1 800 000	1 800 000	0.94%	
SEB Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	A+	S & P	EUR	0.50%	27.09.2022	09.03.2023	190 008	190 008	0.10%	
SEB Pank	Tähtajaline hoius	Eesti	A+	S & P	EUR	0.50%	28.09.2022	09.03.2023	170 005	170 005	0.09%	
3. Muud varad										536 441	0.28%	0.04%
Muud nõuded										522 117	0.27%	
Laekumata dividendid										14 324	0.01%	
VARAD KOKKU										190 736 209	100.05%	100.05%
Fondi kohustused										- 98 286	- 0.05%	- 0.05%
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS										190 637 923	100.00%	100.00%

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

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

² Reguleeritud turul mittekaubeldavad võlaväärtpaberid

³ Instrumenti väärtus on leitud eeskirja LHV Varahalduse investeerimisfondide vara puhasväärtuse määramise eeskiri punktis 3.3. sätestatud viisil, kuna fondivalitseja hinnangul ei ole võimalik instrumenti hinda kindlaks määrata täpselt ja usaldusväärselt turuhinna/ vastava fondi fondivalitseja avaldatud NAVi alusel.

Reguleeritud turul mittekaubeldavate väärtpaperite ja kinniste ning mitteavalike fondide väärtus on leitud vastavalt Aktsiaselts LHV Varahaldus sise-eeskirjas "LHV Varahalduse investeerimisfondide vara puhasväärtuse määramise eeskiri" toodud põhimõtetele ning ei pruugi aruandeperioodi lõpu seisuga kajastada kõigi instrumentide puhul COVID-19 mõju instrumenti väärtusele. Aktsiaselts LHV Varahaldus hindab jooksvalt COVID-19 potentsiaalset mõju fondi investeringutele ning täiendava info teatavaks saamisel teostab nõuetekohased ümberhindlused.