

LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga 31.05.2024

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

13.06.2024

Vahur Vallistu



Joel Kukemelk



Eve Sirel



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.05.2024

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 puhusväärtusest	Osakaal fondi varade puhusväärtusest eelneval kuul
1. Väärtpaberid								24 761 862	25 913 287	96.92%	91.66%	
Võlainstrumendid								22 785 005	23 301 719	87.15%	82.42%	
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	3.84%	88 854.98	977 405	91 987.55	1 011 863	3.78%	
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 ²	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 003.13	702 188	2.63%	
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	6.46%	1 000.00	906 000	928.33	841 070	3.15%	
Kodu Kvarital 8.5% 08/07/2025 ²	NR	-	Eesti	EE3300002682	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 012.51	303 754	1.14%	
Liven Kodu 10 8.5% 30/06/2027 ²	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 014.21	304 262	1.14%	
Luminor 7.75% 08/06/2027	A3	Moody's	Eesti	XS2633112565	EUR	5.29%	1 000.01	1 427 020	1 139.81	1 626 503	6.08%	
Luminor 7.25% 16/01/2026	A3	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	6.27%	1 000.03	650 020	1 041.44	676 936	2.53%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 684.25	2 416 422	9.04%	
Baltic Horizon Fund 08/05/28	NR	-	Eesti	EE3300003235	EUR	11.82%	100 000.00	428 571	100 745.17	431 765	1.61%	
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL ²	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002641	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	101 666.67	203 333	0.76%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	AAA	Fitch	Hispaania	ES0413900160	EUR	3.40%	139 180.79	139 181	103 699.12	103 699	0.39%	
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	4.58%	900.65	720 520	899.48	719 583	2.69%	
Volkswagen AG 4.375% PERPETUAL	BBB	Fitch	Holland	XS2342732646	EUR	5.69%	87 534.59	437 673	92 027.12	460 136	1.72%	
Glencore 1.25% 01/03/2033	BBB+	S&P	Iirimaa	XS2307764311	EUR	4.33%	694.02	902 220	782.44	1 017 167	3.80%	
Siauliu Bankas 1.047% 07/10/25	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	7.01%	1 000.03	600 017	966.78	580 068	2.17%	
Siauliu Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 268.85	862 584	3.23%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	5.36%	1 010.36	1 366 011	973.03	1 315 533	4.92%	
Citadele banka 5% 13/12/2031 ³	Baa2	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	6.03%	10 000.27	750 020	9 664.48	724 836	2.71%	
Citadele banka 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	6.91%	996.28	557 914	918.48	514 349	1.92%	
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	4.66%	966.28	821 337	941.72	800 466	2.99%	
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	4.95%	1 000.06	350 020	1 013.40	354 689	1.33%	
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HA0	EUR	4.40%	86 925.97	869 260	95 373.81	953 738	3.57%	
France Treasury Bill 30/10/2024	AA-	Fitch	Prantsusmaa	FR0128071067	EUR	3.58%	0.97	1 557 650	0.99	1 576 192	5.90%	
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	4.53%	807.20	645 758	896.97	717 578	2.68%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	3.84%	1 043.46	133 563	1 001.21	128 155	0.48%	
German Treasury Bill 16/10/2024	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE000BU0E105	EUR	3.52%	0.01	292 493	0.01	296 022	1.11%	
German Treasury Bill 19/06/24	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE000BU0E063	EUR	2.85%	0.01	1 365 680	0.01	1 397 872	5.23%	
German Treasury Bill 1% 15/08/2024	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001102366	EUR	3.54%	0.01	985 264	0.01	1 002 654	3.75%	
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	4.59%	769.77	887 543	837.64	965 801	3.61%	
BP Capital Markets 3.625% PERP	A3	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	5.74%	834.48	267 034	984.82	315 143	1.18%	
Oodatav krediidikahju (võlainstrumendid)										- 22 640	- 0.08%	
								668	1 063	0.00%	0.00%	
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 puhusväärtusest	Osakaal fondi varade puhusväärtusest eelneval kuul
Aktsiad												
VH Agent 003 osa			Eesti	EE3100005430	EUR		1.24	387	2.15	670	0.00%	
VH Agent 004 osa			Eesti	EE3100005455	EUR		0.97	281	1.36	393	0.00%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.05.2024

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		
Fondiosakud						1 976 189		2 610 505	9.76%	9.24%		
Kinnisvarafondid						713 789		941 465	3.52%	3.32%		
EFTEN Real Estate Fund 5	EFTEN Capital	Eesti	-	EUR	1.00	353 771	1.23	435 761	1.63%			
SG Capital Partners Fund 1	SG Capital Partners	Läti	-	EUR	1.00	360 018	1.40	505 704	1.89%			
Aktsiafondid						1 262 400		1 669 040	6.24%	5.92%		
ZKB Gold ETF	Swisscanto Fondsleitung	Šveits	CH0139101593	CHF	516.39	1 262 400	639.23	1 669 040	6.24%			
Krediitiasutuse nimi	Hoiuse liik	Päritoluriik	Reiting	Reitinguagentuur*	Alusvara nimetus	Intruss	Algus-kuupäev	Löpp-tähtaeg	Hoiustatud summa (EUR)	Turuväärtus kokku (EUR)	Osakaal fondi varade puhasväärtusest	Osakaal fondi varade puhasväärtusest eelneval kuul
2. Hoiused										836 543	3.13%	8.39%
Arvelduskontod												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	Aa3	Moody's	EUR				836 543	836 543	3.13%	
VARAD KOKKU									26 749 830	100.05%	100.05%	
Fondi kohustused									- 13 841	- 0.05%	- 0.05%	
FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS									26 735 989	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 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.