

# LHV Pensionifond S

Investeeringute aruanne seisuga **31.07.2024**

Fondivalitseja AS LHV Varahaldus juhatus on kinnitanud investeeringute aruande

13.08.2024

Vahur Vallistu



Eve Sirel



LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.07.2024

Emitent/väärtpaberi nimetus	Reiting	Reitingu-agentuur*	Emitendi riik	ISIN-kood	Valuuta	Tootlus aegumiseni	Keskmine soetusväärtus 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>23 936 528</b>	<b>25 152 002</b>	<b>92.19%</b>	<b>89.93%</b>		
<b>Võlainstrumendid</b>							<b>21 959 671</b>	<b>22 462 062</b>	<b>82.33%</b>	<b>80.12%</b>		
KBC Group NV 0.625% 07/12/2031	Baa2	Moody's	Belgia	BE0002819002	EUR	3.63%	88 854.98	977 405	92 764.71	1 020 412	3.74%	
BIGBANK 7.5% 16/05/2032 ²	NR	-	Eesti	EE3300002583	EUR	7.50%	1 000.00	700 000	1 015.83	711 083	2.61%	
Coop Pank 5.0% 10/03/2032	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002542	EUR	5.86%	1 000.00	906 000	959.17	869 005	3.19%	
Liven Kodu 10 8.5% 30/06/2027 ²	NR	-	Eesti	EE3300002484	EUR	8.50%	1 000.00	300 000	1 007.22	302 166	1.11%	
Luminor 7.75% 08/06/2027	A3	Moody's	Eesti	XS2633112565	EUR	5.01%	1 000.01	1 427 020	1 074.18	1 532 860	5.62%	
Luminor 7.25% 16/01/2026	A3	Moody's	Eesti	XS2576365188	EUR	6.06%	1 000.03	650 020	1 050.17	682 613	2.50%	
Riigi Kinnisvara 1.61% 09/06/27 ²	NR	-	Eesti	EE3300111236	EUR	1.61%	100 284.64	2 406 831	100 138.64	2 403 327	8.81%	
Baltic Horizon Fund 08/05/28	NR	-	Eesti	EE3300003235	EUR	11.82%	100 000.00	314 286	102 721.04	322 838	1.18%	
Coop Pank AT1 10% PERPETUAL ²	Baa2	Moody's	Eesti	EE3300002641	EUR	10.00%	100 000.00	200 000	100 833.34	201 667	0.74%	
Eesti Energia perpetual NCS.25	B1	Moody's	Eesti	XS2824761188	EUR	7.45%	998.31	1 856 852	1 018.45	1 894 321	6.94%	
Banco Santander 4.625% 04/05/27	AAA	Fitch	Hispaania	ES0413900160	EUR	2.93%	139 180.79	139 181	105 545.07	105 545	0.39%	
PROSUS 1.539% 03/08/2028	BBB	S&P	Holland	XS2211183244	EUR	4.30%	900.65	720 520	915.67	732 539	2.68%	
Volkswagen AG 4.375% PERPETUAL	BBB	Fitch	Holland	XS2342732646	EUR	5.55%	87 534.59	437 673	93 378.29	466 891	1.71%	
Siauliu Bankas 1.047% 07/10/25	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000405771	EUR	4.81%	1 000.03	600 017	998.02	598 815	2.19%	
Siauliu Bankas 6.15% 23/12/29	Baa1	Moody's	Leedu	LT0000404287	EUR	6.14%	10 000.00	840 000	10 371.35	871 194	3.19%	
ALTUMG 1.3% 07/03/25	Baa1	Moody's	Läti	LV0000880037	EUR	4.30%	1 010.36	1 366 011	987.48	1 335 073	4.89%	
Citadele banka 5% 13/12/2031	Baa2	Moody's	Läti	LV0000880102	EUR	6.01%	10 000.27	750 020	9 518.85	713 914	2.62%	
Citadele banka 1.625% 22/11/2026	Baa3	Moody's	Läti	XS2393742122	EUR	5.83%	996.28	557 914	945.19	529 306	1.94%	
Latvenergo 2.42% 05/05/2027	Baa2	Moody's	Läti	LV0000870129	EUR	4.77%	966.28	821 337	946.31	804 363	2.95%	
Latvenergo 4.952% 22/02/2029	Baa2	Moody's	Läti	LV0000802684	EUR	4.82%	1 000.06	350 020	1 026.65	359 327	1.32%	
BNP Paribas 2.5% 31/03/2032	A-	Fitch	Prantsusmaa	FR0014009HAD	EUR	4.17%	86 925.97	869 260	96 697.62	966 976	3.54%	
France Treasury Bill 30/10/2024	AA-	S&P	Prantsusmaa	FR0128071067	EUR	3.51%	0.97	1 557 650	0.99	1 585 952	5.81%	
EQT AB 2.875% 06/04/2032	A-	Fitch	Rootsi	XS2463990775	EUR	4.11%	807.20	645 758	929.26	743 406	2.72%	
Romania 2.75% 29/10/25	Baa3	Moody's	Rumeenia	XS1312891549	EUR	3.75%	1 043.46	133 563	1 008.77	129 122	0.47%	
German Treasury Bill 16/10/2024	Aaa	Moody's	Saksamaa	DE0008080105	EUR	3.25%	0.01	292 493	0.01	297 933	1.09%	
German Treasury Bill 1% 15/08/2024	AAA	S&P	Saksamaa	DE0001102366	EUR	3.41%	0.01	985 264	0.01	1 008 570	3.70%	
Kojamo 0.875% 28/05/2029	Baa2	Moody's	Soome	XS2345877497	EUR	4.07%	769.77	887 543	864.08	996 289	3.65%	
BP Capital Markets 3.625% PERP	A3	Moody's	Suurbritannia	XS2193662728	EUR	5.59%	834.48	267 034	962.87	308 119	1.13%	
Oodatav krediidikahju (võlainstrumendid)										- 31 563	- 0.12%	
<b>Emitent/väärtpaberi nimetus</b>							<b>Keskmine soetusväärtus 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>1 187</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>		
VH Agent 003 osa			Eesti	EE3100005430	EUR		1.24	387	1.99	622	0.00%	
VH Agent 004 osa ¹			Eesti	EE3100005455	EUR		0.97	281	1.95	565	0.00%	
<b>Fondi osaku või aktsia nimetus</b>							<b>Keskmine soetusväärtus 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>Fondiosakud</b>							<b>1 976 189</b>	<b>2 688 752</b>	<b>9.85%</b>	<b>9.80%</b>		
<b>Kinnisvarafondid</b>							<b>713 789</b>	<b>948 451</b>	<b>3.48%</b>	<b>3.51%</b>		
EFEN Real Estate Fund 5			Eesti	-	EUR		1.00	353 771	1.23	435 772	1.60%	
SG Capital Partners Fund 1			Läti	-	EUR		1.00	360 018	1.42	512 679	1.88%	
<b>Aktsiafondid</b>							<b>1 262 400</b>	<b>1 740 301</b>	<b>6.38%</b>	<b>6.29%</b>		
ZKB Gold ETF			Šveits	CH0139101593	CHF		531.83	1 262 400	666.53	1 740 301	6.38%	

LHV Pensionifond S investeringute aruanne seisuga 31.07.2024

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
<b>2. Hoiused</b>										<b>2 146 112</b>	<b>7.87%</b>	<b>10.12%</b>
<b>Arvelduskontod</b>												
Arvelduskonto EUR, SEB	Nõudmiseni hoius	Eesti	Aa3	Moody's	EUR				2 146 112	2 146 112	7.87%	
<b>VARAD KOKKU</b>										<b>27 298 113</b>	<b>100.05%</b>	<b>100.05%</b>
Fondi kohustused										- 14 040	- 0.05%	- 0.05%
<b>FONDI VARADE PUHASVÄÄRTUS</b>										<b>27 284 073</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