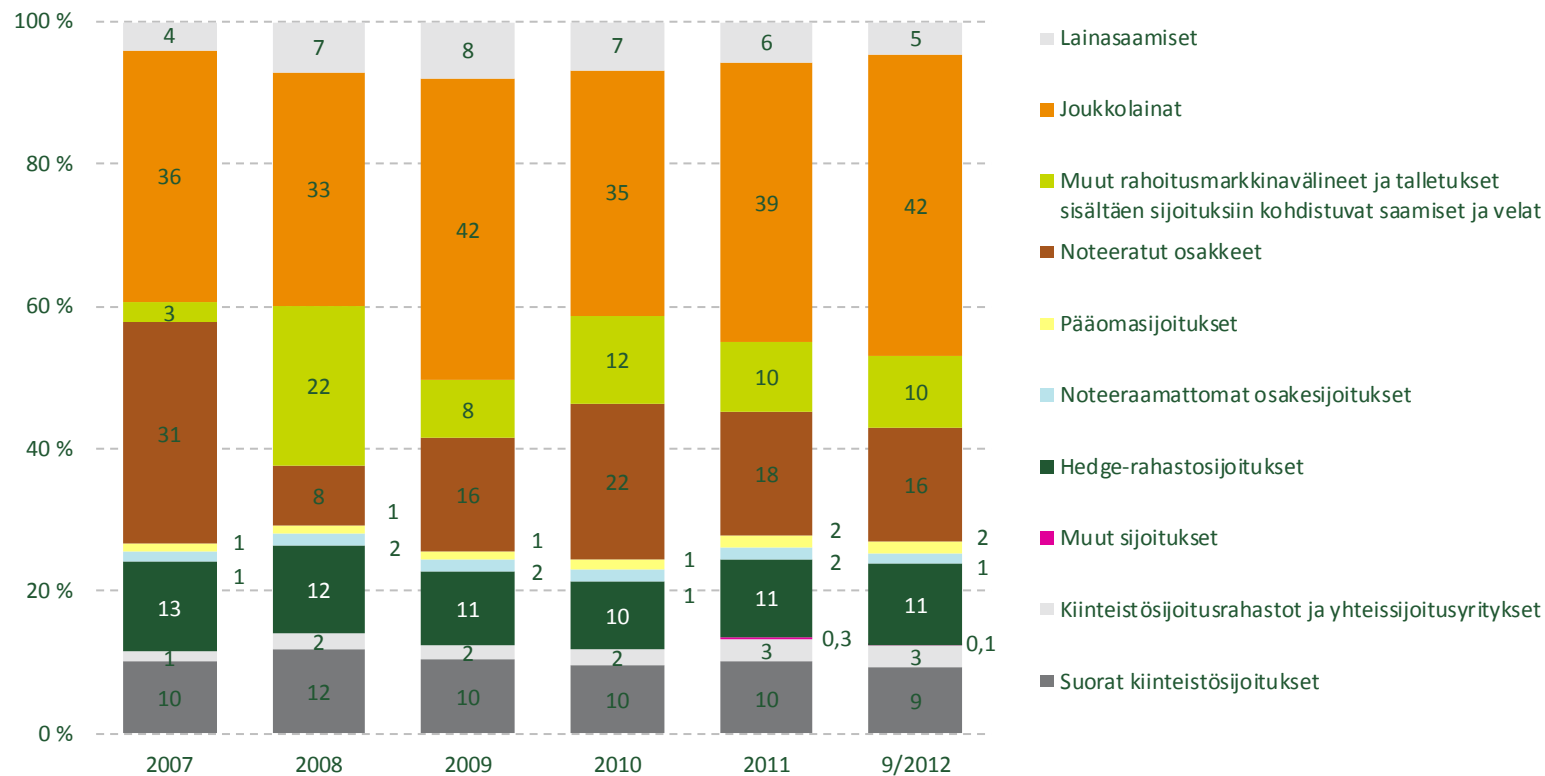
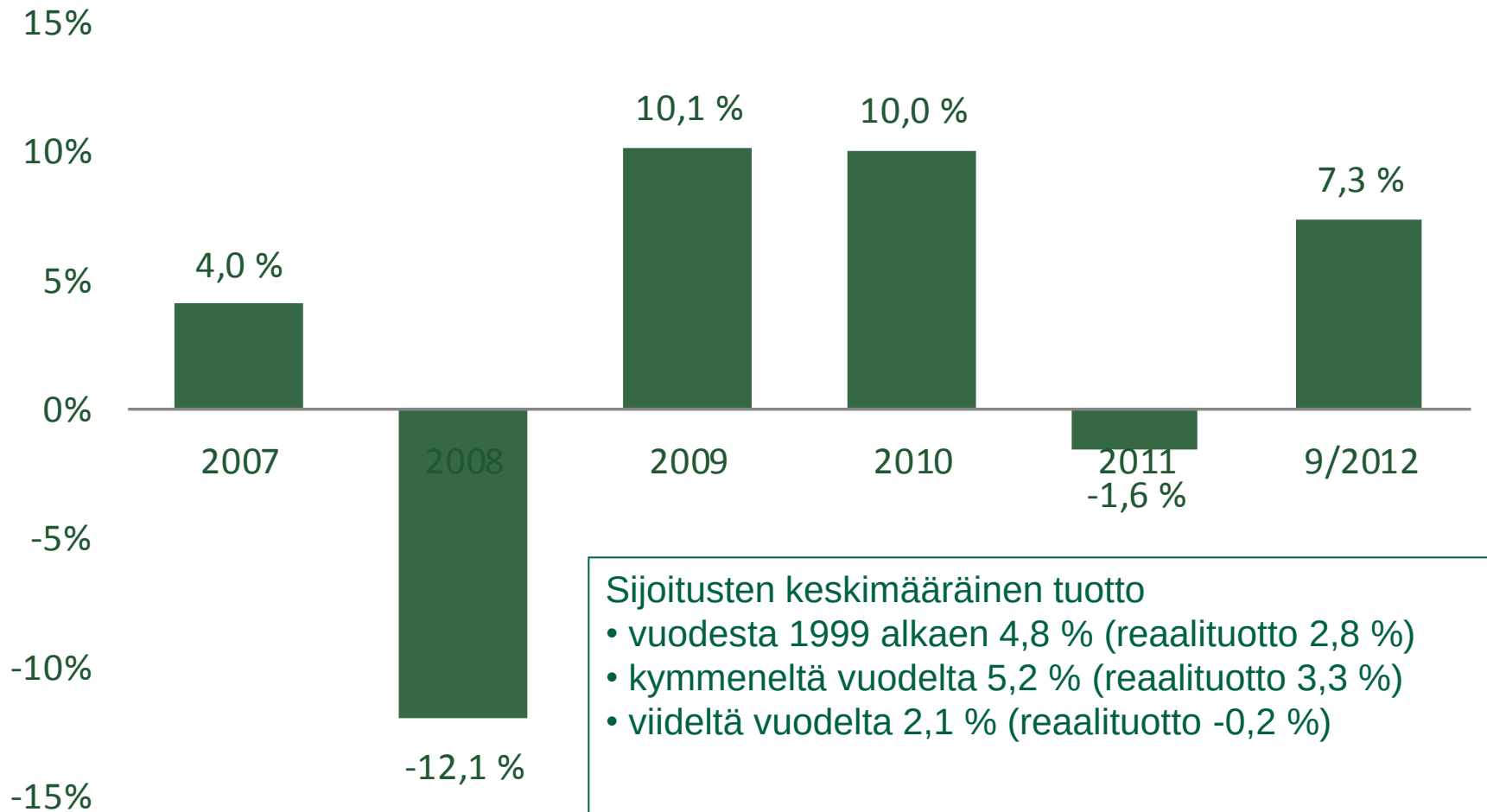


Osavuositarkastus 30.9.2012

Eläke-Fennian riskikorjattu sijoitusjakauma



Sijoitustuotot 2007 – 9/2012



Sijoitusten riskijakauma ja riskiluvut 30.9.2012

	Markkina-arvo		Riskijakauma		Tuotto	Vola
	milj. e	%	milj. e	%	%	%
Korkosijoitukset	4 254,7	57,9	4 199,2	57,1	6,9 %	
Lainasaamiset	344,6	4,7	344,6	4,7	2,3 %	
OECD/ETA-julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	889,4	12,1	696,3	9,5	4,2 %	3,4 %
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 409,6	32,8	2 409,6	32,8	10,3 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset sisältäen sijoituksiin kohdistuvat saamiset ja velat	611,2	8,3	748,7	10,2	1,0 %	
Osakesijoitukset	1 340,1	18,2	1 395,6	19,0	11,8 %	
Noteeratut osakkeet	1 105,8	15,0	1 161,3	15,8	12,8 %	14,6 %
Pääomasijoitukset	135,2	1,8	135,2	1,8	7,1 %	
Noteeraamattomat osakesijoitukset	99,1	1,3	99,1	1,3	5,6 %	
Kiinteistösijoitukset	909,1	12,4	909,1	12,4	5,2 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	682,1	9,3	682,1	9,3	6,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	227,0	3,1	227,0	3,1	2,8 %	
Muut sijoitukset	845,1	11,5	845,1	11,5	4,1 %	
Hedge-rahastosijoitukset	838,8	11,4	838,8	11,4	6,5 %	4,4 %
Muut sijoitukset	6,3	0,1	6,3	0,1	-37,3 %	
Sijoitukset yhteensä	7 349,1	100,0	7 349,1	100,0	7,3 %	4,2 %

Markkina-arvo sisältää kertyneet korot

Riskijakauma = riskin mukaan laskettu (johdannaisilla oikaistu)

Tuotto = aika ja rahapainotteisella kaavalla laskettu tuotto sitoutuneelle pääomalle (mukautettu Dietz)

Volatiliteetti = kahden vuoden kuukausituotoista laskettu annualisoitu keskihajonta

Joukkolainojen modifioitu duraatio on 4,2 vuotta

Eläke-Fennian vakavaraisuus

Toimintapääoma ja vakavaraisuusraja

