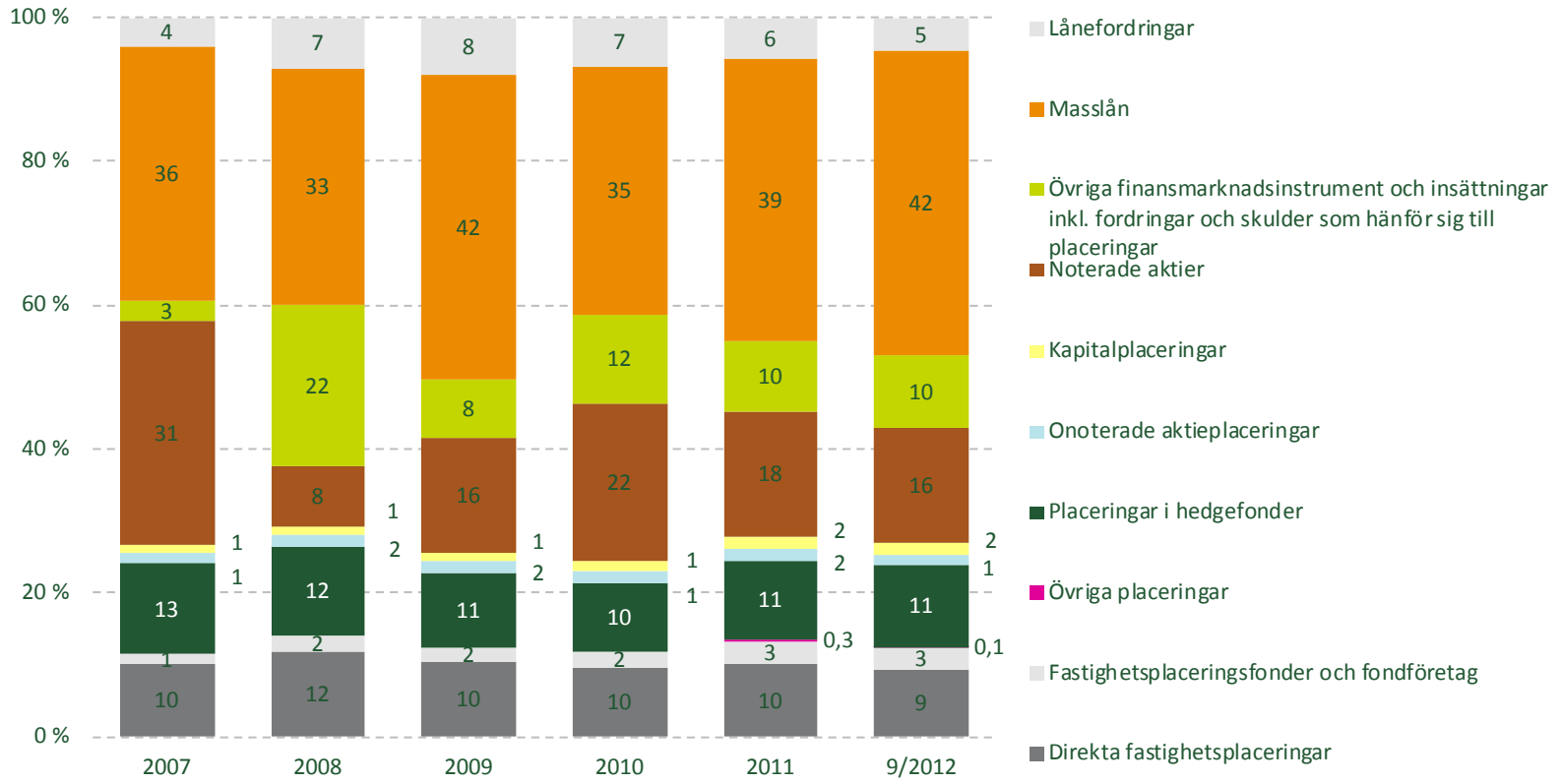
Delårsrapport 30.9.2012

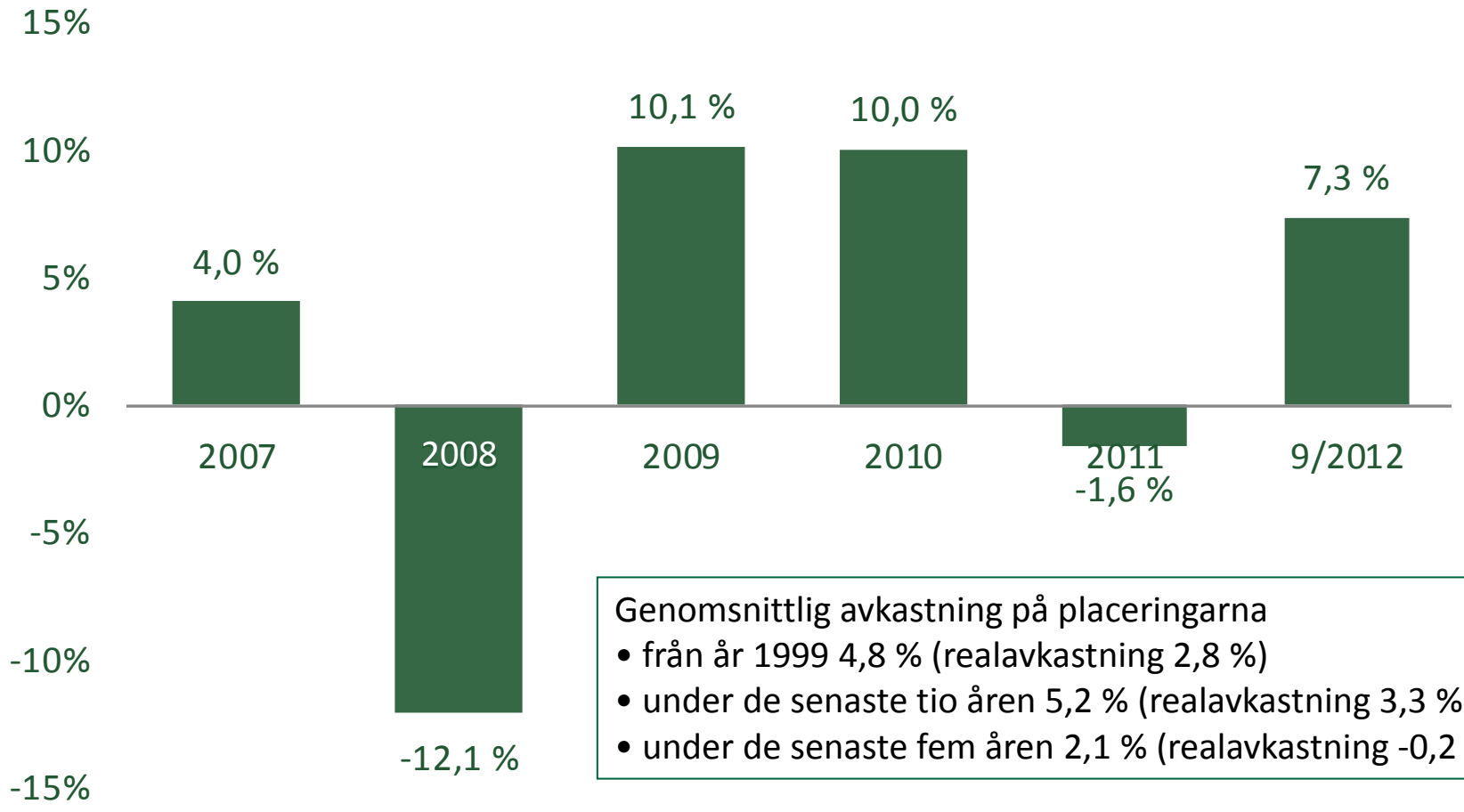
Pensions-Fennia

Fördelningen av Pensions-Fennias placeringsbestånd



Pensions-Fennia

Placeringsintäkter 2007 – 9/2012



Genomsnittlig avkastning på placeringarna
- från år 1999 4,8 % (realavkastning 2,8 %)
- under de senaste tio åren 5,2 % (realavkastning 3,3 %)
- under de senaste fem åren 2,1 % (realavkastning -0,2 %)

Pensions-Fennia

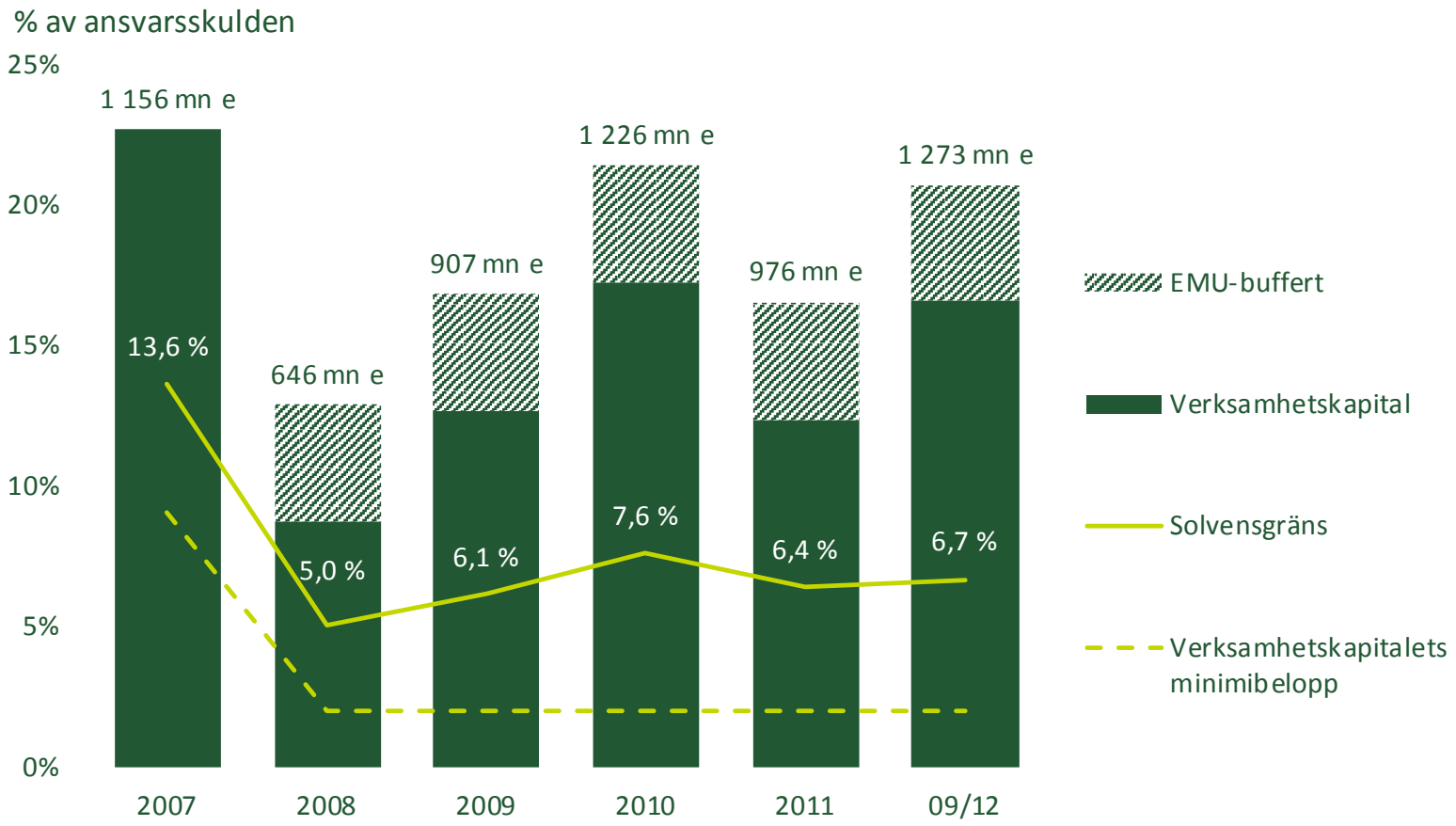
Riskfördelning och risktal för Pensions-Fennias placeringar 30.9.2012

	Marknadsvärde		Riskfördelning		Avkastning	Volatilitet
	mn e	%	mn e	%	%	%
Ränteplaceringar	**4 254,7**	**57,9**	**4 199,2**	**57,1**	**6,9 %**	
Lånefordringar	344,6	4,7	344,6	4,7	2,3 %	
Masskulebrevslån i offentliga samfund inom OECD/EES	889,4	12,1	696,3	9,5	4,2 %	3,4 %
Masskuldebrevslån i andra samfund	2 409,6	32,8	2 409,6	32,8	10,3 %	
Övriga finansmarknadsinstrument och insättningar inkl. fordringar och skulder som hänför sig till placeringar	611,2	8,3	748,7	10,2	1,0 %	
Aktieplaceringar	**1 340,1**	**18,2**	**1 395,6**	**19,0**	**11,8 %**	
Noterade aktier	1 105,8	15,0	1 161,3	15,8	12,8 %	14,6 %
Kapitalplaceringar	135,2	1,8	135,2	1,8	7,1 %	
Onoterade aktieplaceringar	99,1	1,3	99,1	1,3	5,6 %	
Fastighetsplaceringar	**909,1**	**12,4**	**909,1**	**12,4**	**5,2 %**	
Direkta fastighetsplaceringar	682,1	9,3	682,1	9,3	6,0 %	
Fastighetsplaceringsfonder och fondföretag	227,0	3,1	227,0	3,1	2,8 %	
Övriga placeringar	**845,1**	**11,5**	**845,1**	**11,5**	**4,1 %**	
Placeringar i hedgefonder	838,8	11,4	838,8	11,4	6,5 %	4,4 %
Övriga placeringar	6,3	0,1	6,3	0,1	-37,3 %	
Placeringar sammanlagt	**7 349,1**	**100,0**	**7 349,1**	**100,0**	**7,3 %**	**4,2 %**

Marknadsvärdet inkluderar upplupna räntor
Riskfördelning = räknat enligt risk (korrigerat med derivat)
Avkastning = Avkastning på sysselsatt kapital räknat med en tids- och penningavvägd formel (anpassad Dietz-formel)
Volatilitet = annualiserad standardavvikelse som räknats utifrån månadsavkastningen under två år
Masslånens modifierade duration är 4,2 år

Pensions-Fennia

Pensions-Fennias solvens
Verksamhetskapital och dess gränser



Pensions-Fennia