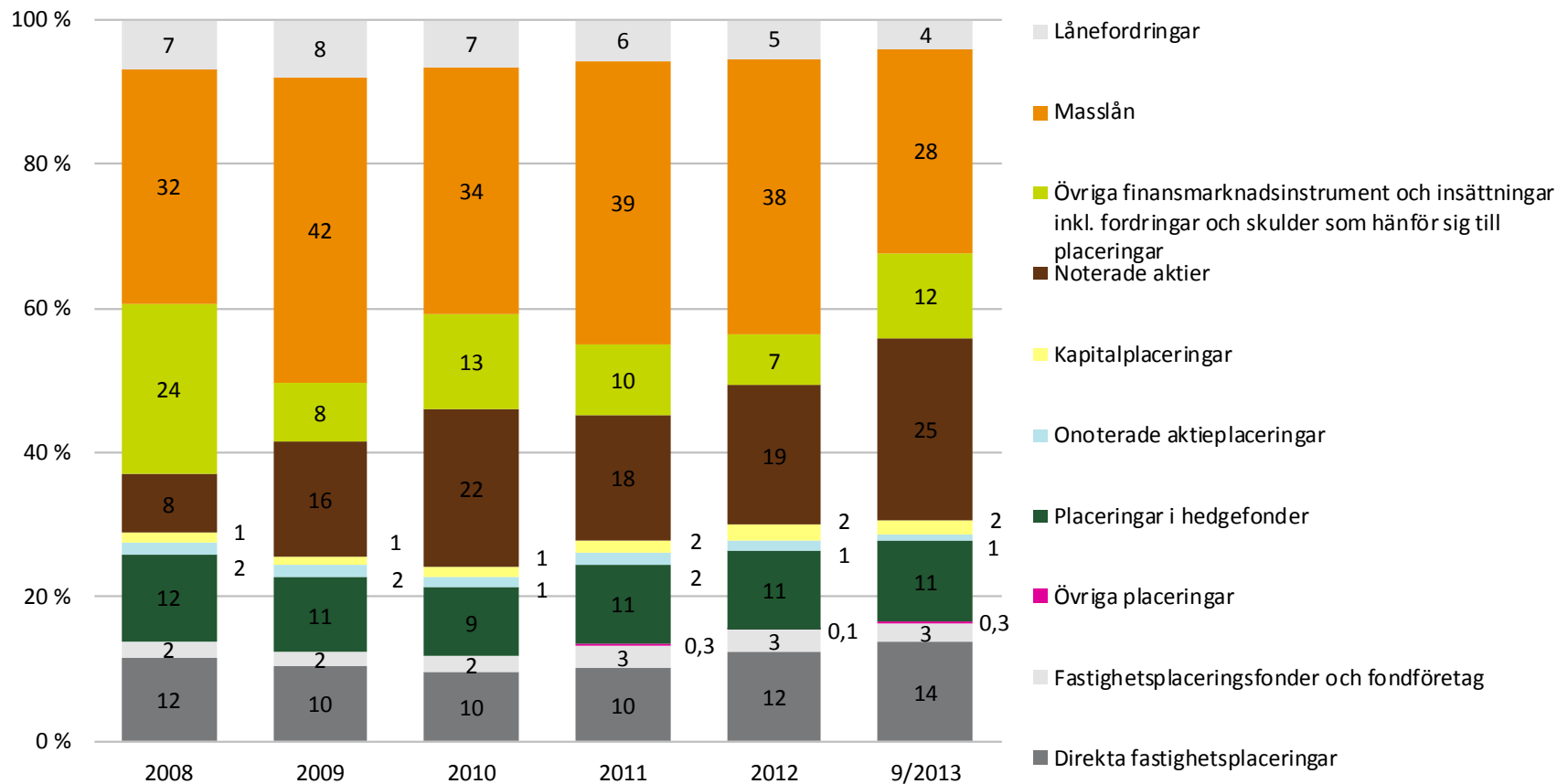




Delårsrapport 30.9.2013

Riskkorrigerad fördelning av tillgångarna



Derivatet har beaktats till delkorrigerade värden

Placeringarnas riskfördelning och risktal

30.9.2013

	Marknadsvärde		Riskfördelning		Avkastning	Volatilitet
	mn e	%	mn e	%	%	%
Ränteplaceringar	3 463,8	43,3	3 531,9	44,2	0,6 %	
Lånefordringar	330,0	4,1	330,0	4,1	2,3 %	
Masskulebrevslån i offentliga samfund inom OECD/EES	561,5	7,0	492,7	6,2	0,5 %	3,7 %
Masskuldebrevslån i andra samfund	1 754,7	22,0	1 754,7	22,0	0,5 %	
Övriga finansmarknadsinstrument och insättningar inkl. fordringar och skulder som hänförs till placeringar	817,6	10,2	954,5	11,9	0,2 %	
Aktieplaceringar	2 317,3	29,0	2 249,3	28,1	13,3 %	
Noterade aktier	2 078,4	26,0	2 010,3	25,2	14,7 %	11,8 %
Kapitalplaceringar	171,9	2,2	171,9	2,2	5,3 %	
Onoterade aktieplaceringar	67,0	0,8	67,0	0,8	0,3 %	
Fastighetsplaceringar	1 308,3	16,4	1 308,3	16,4	13,4 %	
Direkta fastighetsplaceringar	1 093,5	13,7	1 093,5	13,7	15,0 %	
Fastighetsplaceringsfonder och fondföretag	214,8	2,7	214,8	2,7	6,5 %	
Övriga placeringar	903,5	11,3	903,5	11,3	5,3 %	
Placeringar i hedgefonder	882,2	11,0	882,2	11,0	5,2 %	3,0 %
Övriga placeringar	21,3	0,3	21,3	0,3	10,6 %	
Placeringar sammanlagt	7 992,9	100,0	7 992,9	100,0	6,3 %	4,0 %

Marknadsvärdet inkluderar upplupna räntor

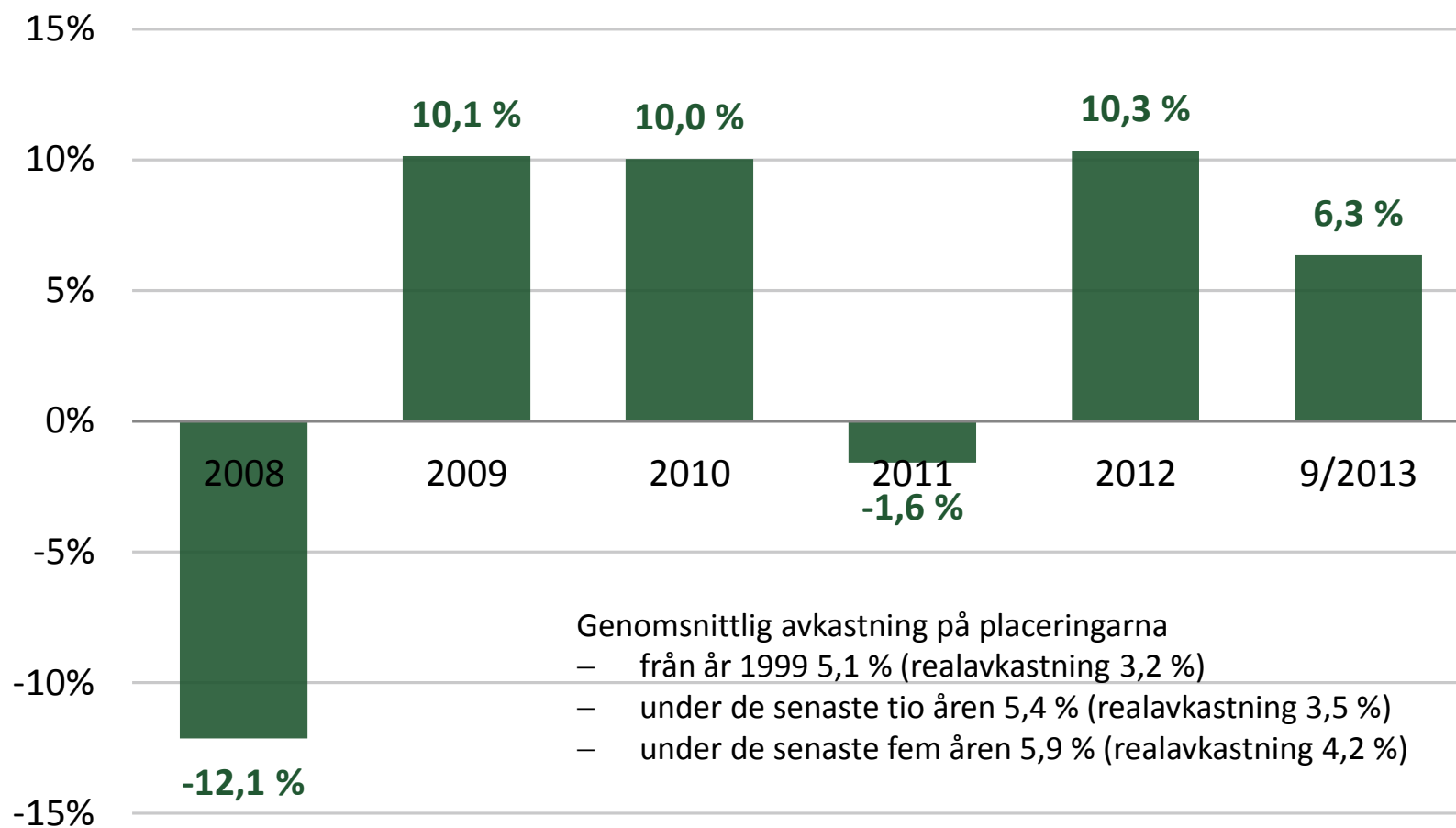
Riskfördelning = räknat enligt risk (korrigerat med derivat)

Avkastning = Avkastning på sysselsatt kapital räknat med en tids- och penningvägd formel (anpassad Dietz-formel)

Volatilitet = annualiserad standardavvikelse som räknats utifrån månadsavkastningen under två år

Masslårens modifierade duration är 3,6 år

Placeringsintäkter



Solvens

Solvenskapital och dess gränser

% av ansvarsskulden

