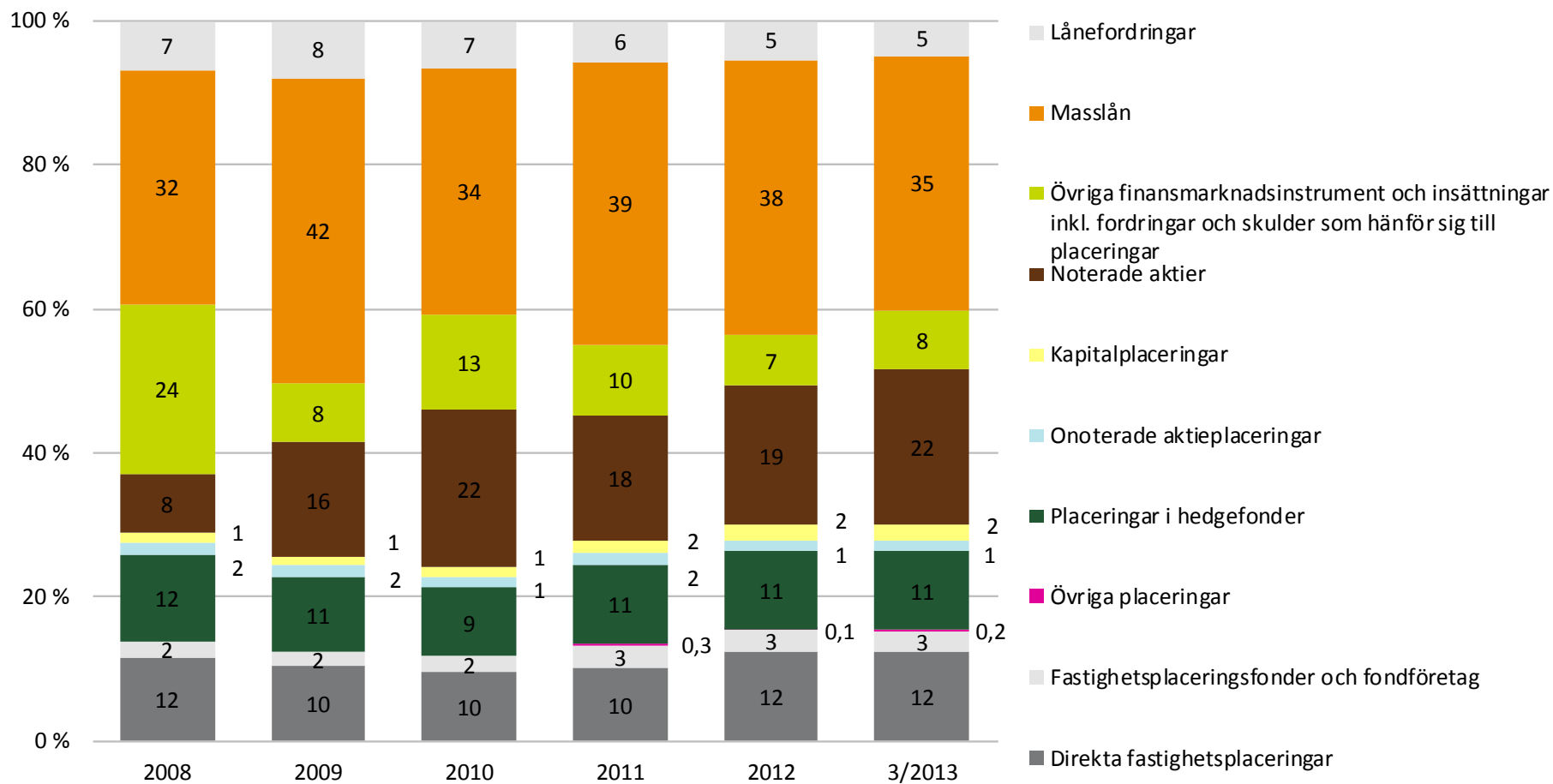




Delårsrapport 31.3.2013

Riskkorrigerade fördelning av tillgångarna



Derivaten har beaktats till deltakorrigerade värden

Placeringarnas riskfördelning och risktal

31.3.2013

	Marknadsvärde		Riskfördelning		Avkastning	Volatilitet
	mn e	%	mn e	%	%	%
Ränteplaceringar	3 756,4	48,4	3 756,4	48,4	0,6 %	
Lånefordringar	369,4	4,8	369,4	4,8	0,8 %	
Masskulebrevslån i offentliga samfund inom OECD/EES	614,9	7,9	470,9	6,1	-0,3 %	3,3 %
Masskuldebrevslån i andra samfund	2 280,6	29,4	2 280,6	29,4	1,0 %	
Övriga finansmarknadsinstrument och insättningar inkl. fordringar och skulder som hänför sig till placeringar	491,6	6,3	635,6	8,2	0,2 %	
Aktieplaceringar	1 960,2	25,3	1 960,2	25,3	7,6 %	
Noterade aktier	1 668,1	21,5	1 668,1	21,5	7,7 %	14,5 %
Kapitalplaceringar	181,0	2,3	181,0	2,3	6,6 %	
Onoterade aktieplaceringar	111,1	1,4	111,1	1,4	7,1 %	
Fastighetsplaceringar	1 180,3	15,2	1 180,3	15,2	1,8 %	
Direkta fastighetsplaceringar	959,8	12,4	959,8	12,4	1,2 %	
Fastighetsplaceringsfonder och fondföretag	220,6	2,8	220,6	2,8	4,6 %	
Övriga placeringar	856,3	11,0	856,3	11,0	3,7 %	
Placeringar i hedgefonder	842,0	10,9	842,0	10,9	3,8 %	4,2 %
Övriga placeringar	14,3	0,2	14,3	0,2	2,3 %	
Placeringar sammanlagt	7 753,2	100,0	7 753,2	100,0	2,8 %	4,2 %

Marknadsvärdet inkluderar upplupna räntor

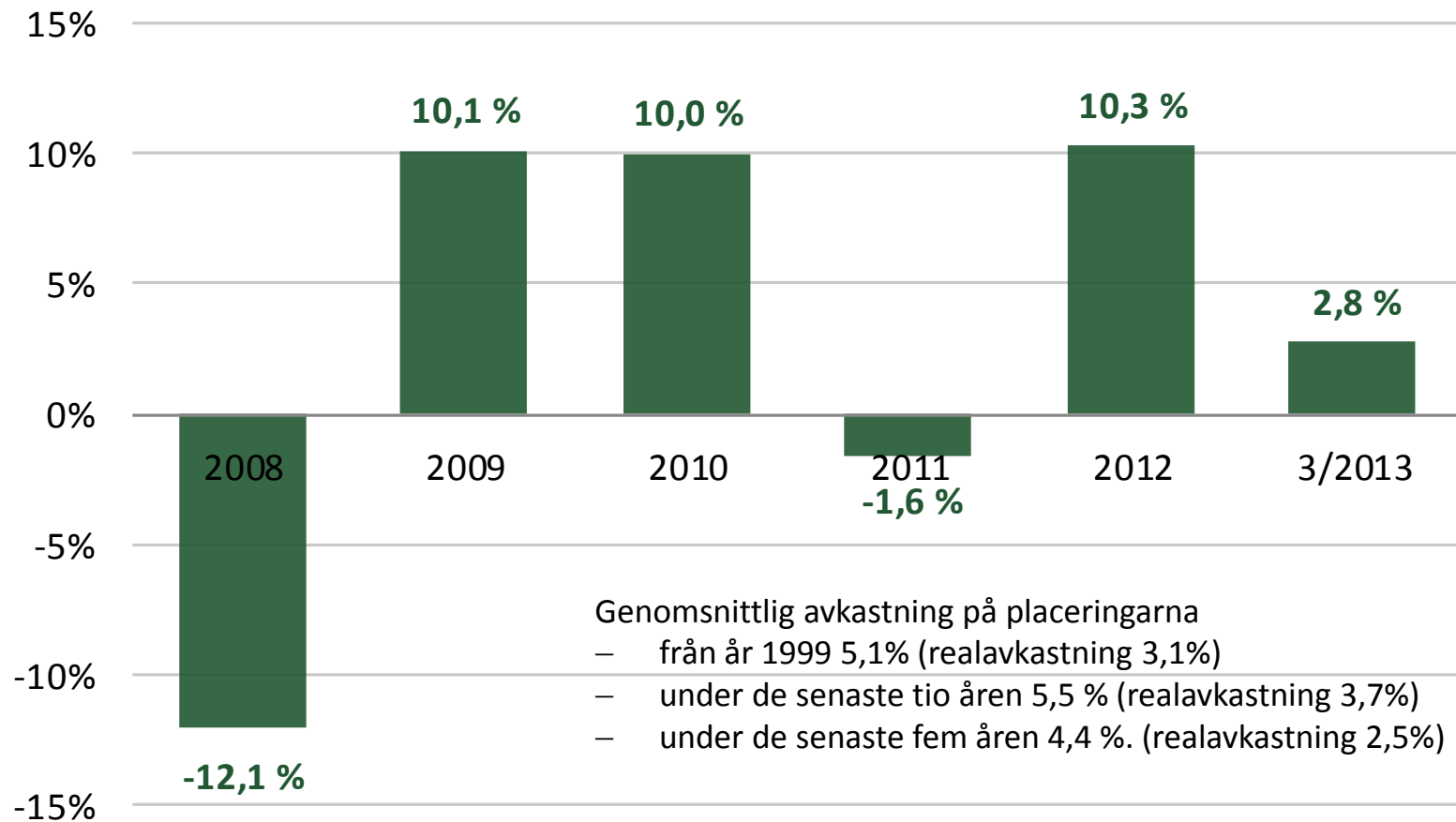
Riskfördelning = räknat enligt risk (korrigerat med derivat)

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 3,84 år

Placeringsintäkter



Solvens

Solvenskapital och dess gränser

% av ansvarsskulden

