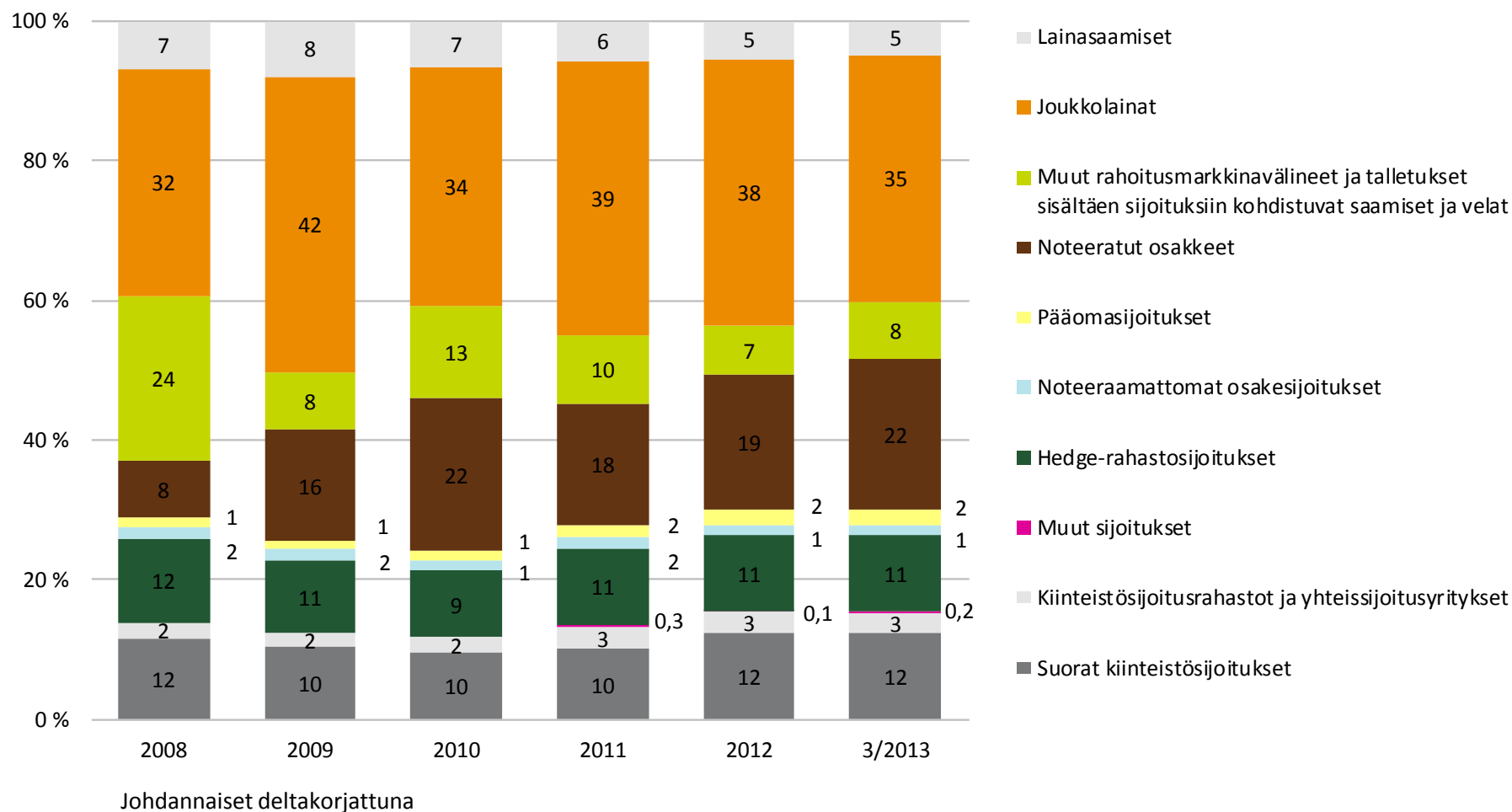




Osavuosikatsaus 31.3.2013

Riskikorjattu omaisuusjakauma



Sijoitusten riskijakauma ja riskiluvut 31.3.2013

	Markkina-arvo		Riskijakauma		Tuotto	Vola
	milj. e	%	milj. e	%	%	%
Korkosijoitukset	3 756,4	48,4	3 756,4	48,4	0,6 %	
Lainasaamiset	369,4	4,8	369,4	4,8	0,8 %	
OECD/ETA-julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	614,9	7,9	470,9	6,1	-0,3 %	3,3 %
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 280,6	29,4	2 280,6	29,4	1,0 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset sisältäen sijoituksiin kohdistuvat saamiset ja velat	491,6	6,3	635,6	8,2	0,2 %	
Osakesijoitukset	1 960,2	25,3	1 960,2	25,3	7,6 %	
Noteeratut osakkeet	1 668,1	21,5	1 668,1	21,5	7,7 %	14,5 %
Pääomasijoitukset	181,0	2,3	181,0	2,3	6,6 %	
Noteeraamattomat osakesijoitukset	111,1	1,4	111,1	1,4	7,1 %	
Kiinteistösijoitukset	1 180,3	15,2	1 180,3	15,2	1,8 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	959,8	12,4	959,8	12,4	1,2 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	220,6	2,8	220,6	2,8	4,6 %	
Muut sijoitukset	856,3	11,0	856,3	11,0	3,7 %	
Hedge-rahastosijoitukset	842,0	10,9	842,0	10,9	3,8 %	4,2 %
Muut sijoitukset	14,3	0,2	14,3	0,2	2,3 %	
Sijoitukset yhteensä	7 753,2	100,0	7 753,2	100,0	2,8 %	4,2 %

Markkina-arvo sisältää kertyneet korot

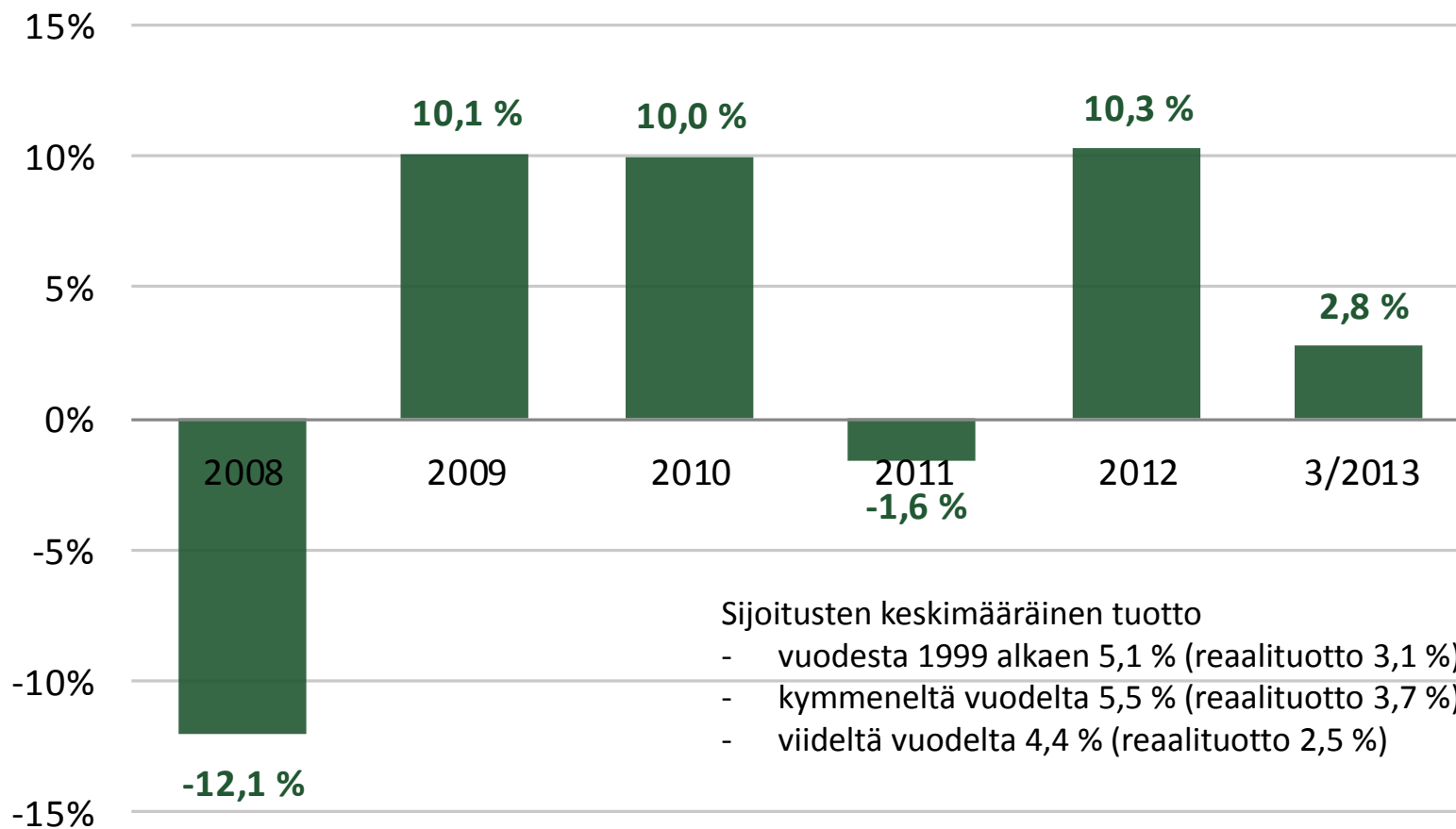
Riskijakauma = riskin mukaan laskettu (johdannaisilla oikaistu)

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

Volatiliteetti = kahden vuoden kuukausituotoista laskettu annualisoitu keskihajonta

Joukkolainojen modifioitu duraatio on 3,84 vuotta

Sijoitustuotot



Vakavaraisuus

Vakavaraisuuspääoma ja sen rajat

