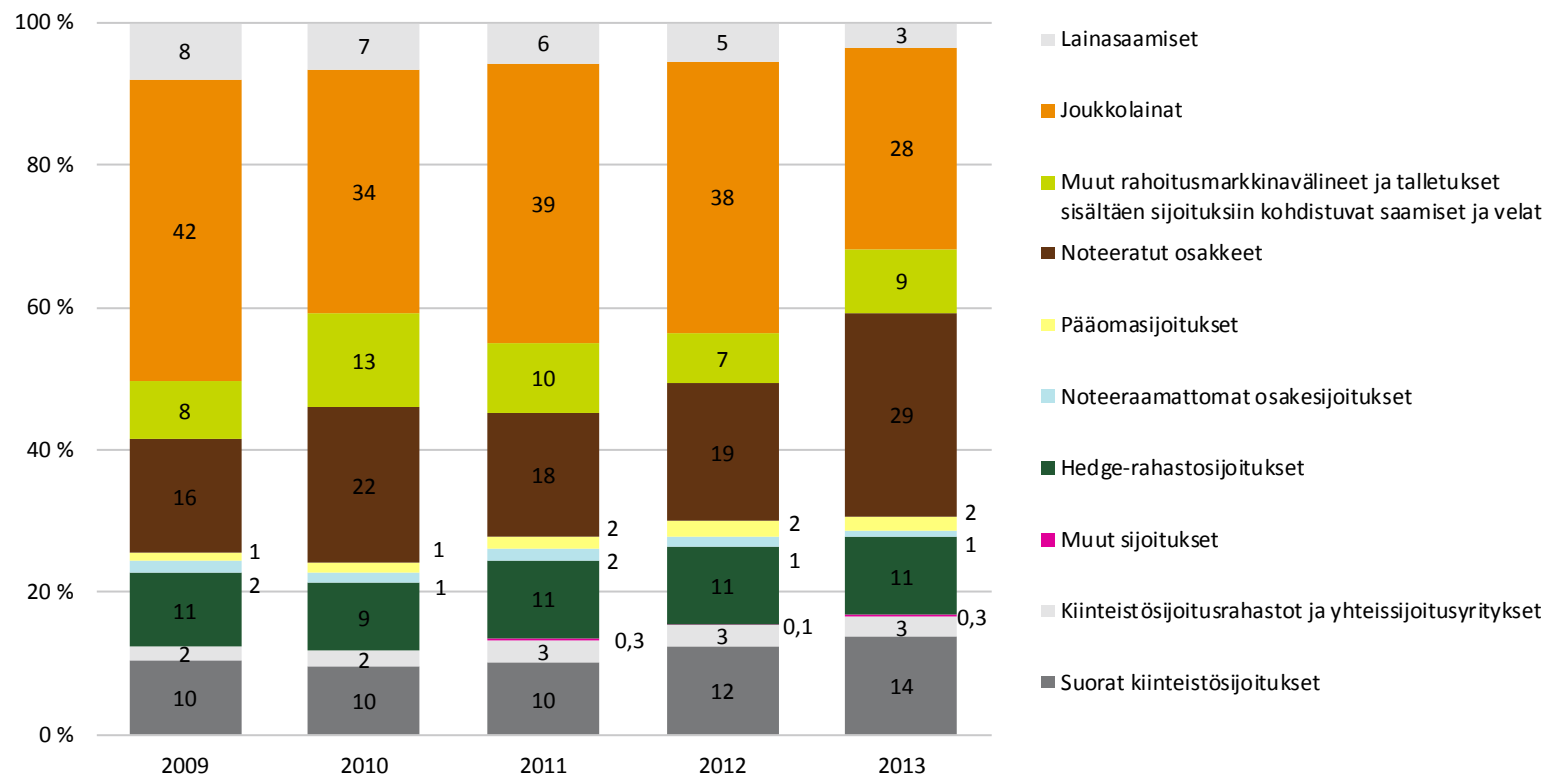




Eläke-Fennian tilinpäätös 2013

Ennakkotiedot

Riskikorjattu sijoitusjakauma



Sijoitusten riskijakauma ja riskiluvut 31.12.2013

	Markkina-arvo		Riskijakauma		Tuotto	Vola
	milj. e	%	milj. e	%	%	%
Korkosijoitukset	3 319,3	40,7	3 319,3	40,7	1,6 %	
Lainasaamiset	271,3	3,3	271,3	3,3	3,5 %	
Joukkovelkakirjalainat	2 315,5	28,4	2 315,5	28,4	1,7 %	3,5 %
OECD/ETA-julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	541,1	6,6	541,1	6,6	0,9 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	1 774,4	21,8	1 774,4	21,8	1,9 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset sisältäen sijoituksiin kohdistuvat saamiset ja velat	732,4	9,0	732,4	9,0	0,3 %	
Osakesijoitukset	2 576,3	31,6	2 576,3	31,6	20,3 %	
Noteeratut osakkeet	2 333,7	28,6	2 333,7	28,6	22,1 %	10,0 %
Pääomasijoitukset	172,4	2,1	172,4	2,1	10,7 %	
Noteeraamattomat osakesijoitukset	70,2	0,9	70,2	0,9	1,6 %	
Kiinteistösijoitukset	1 341,9	16,5	1 341,9	16,5	15,0 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	1 124,8	13,8	1 124,8	13,8	16,3 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	217,1	2,7	217,1	2,7	9,0 %	
Muut sijoitukset	914,8	11,2	914,8	11,2	9,1 %	
Hedge-rahastosijoitukset	893,0	11,0	893,0	11,0	9,0 %	2,9 %
Muut sijoitukset	21,7	0,3	21,7	0,3	10,7 %	
Sijoitukset yhteensä	8 152,3	100,0	8 152,3	100,0	9,4 %	3,6 %
Johdannaisten vaikutus			0,0	0,0		
Yhteensä	8 152,3	100,0	8 152,3	100,0	9,4 %	3,6 %

Laadittu Telan ohjeiden mukaan

Markkina-arvo sisältää kertyneet korot

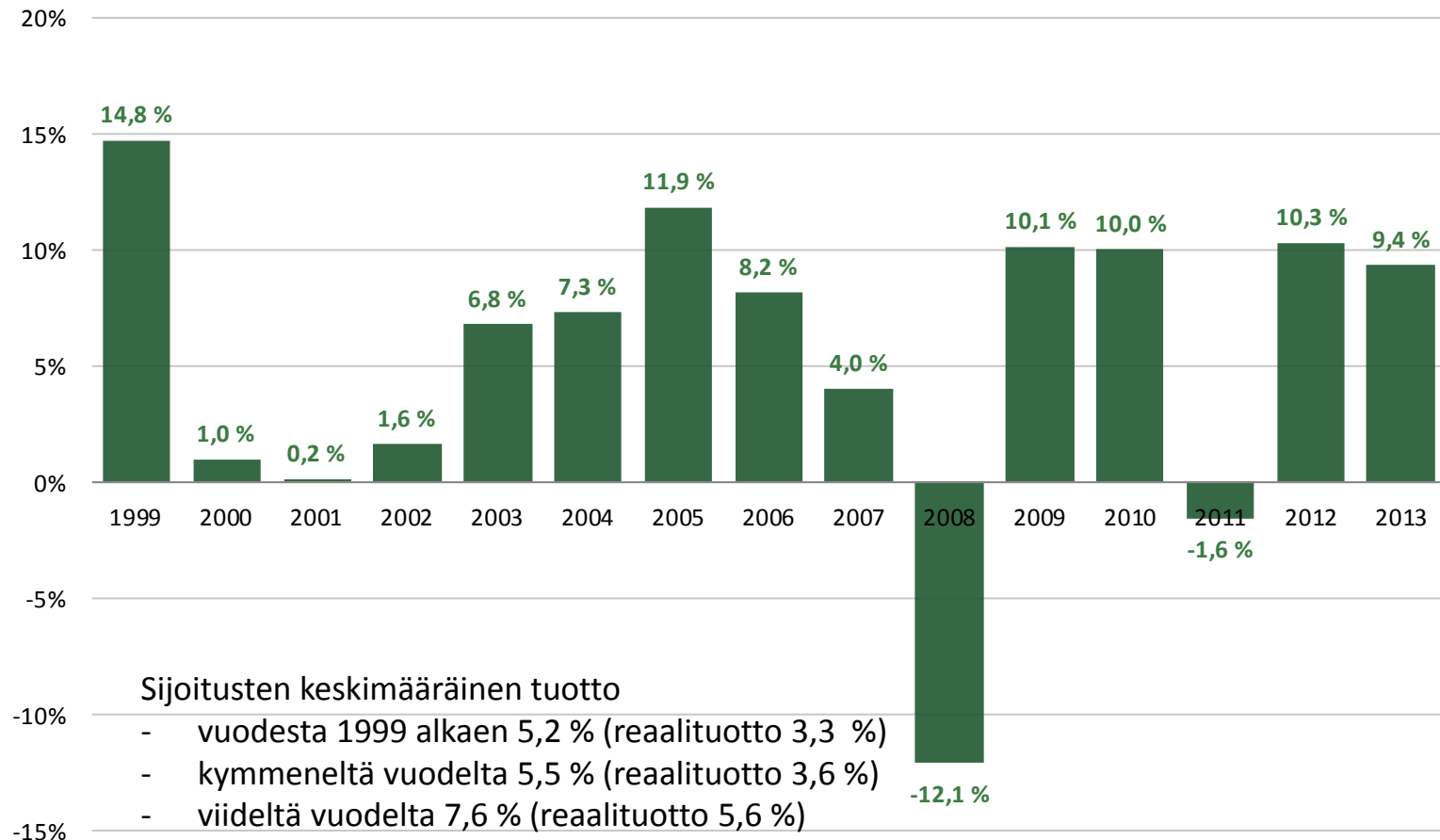
Riskijakauma = riskin mukaan laskettu (johdannaisilla oikaistu)

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

Volatiliteetti = kahden vuoden kuukausituotoista laskettu annualisoitu keskihajonta

Joukkolainojen modifioitu duraatio on 3,7 vuotta

Sijoitustuotot 1999 - 2013



Vakavaraisuus

Vakavaraisuuspääoma ja vakavaraisuusraja

% vastuuelasta

