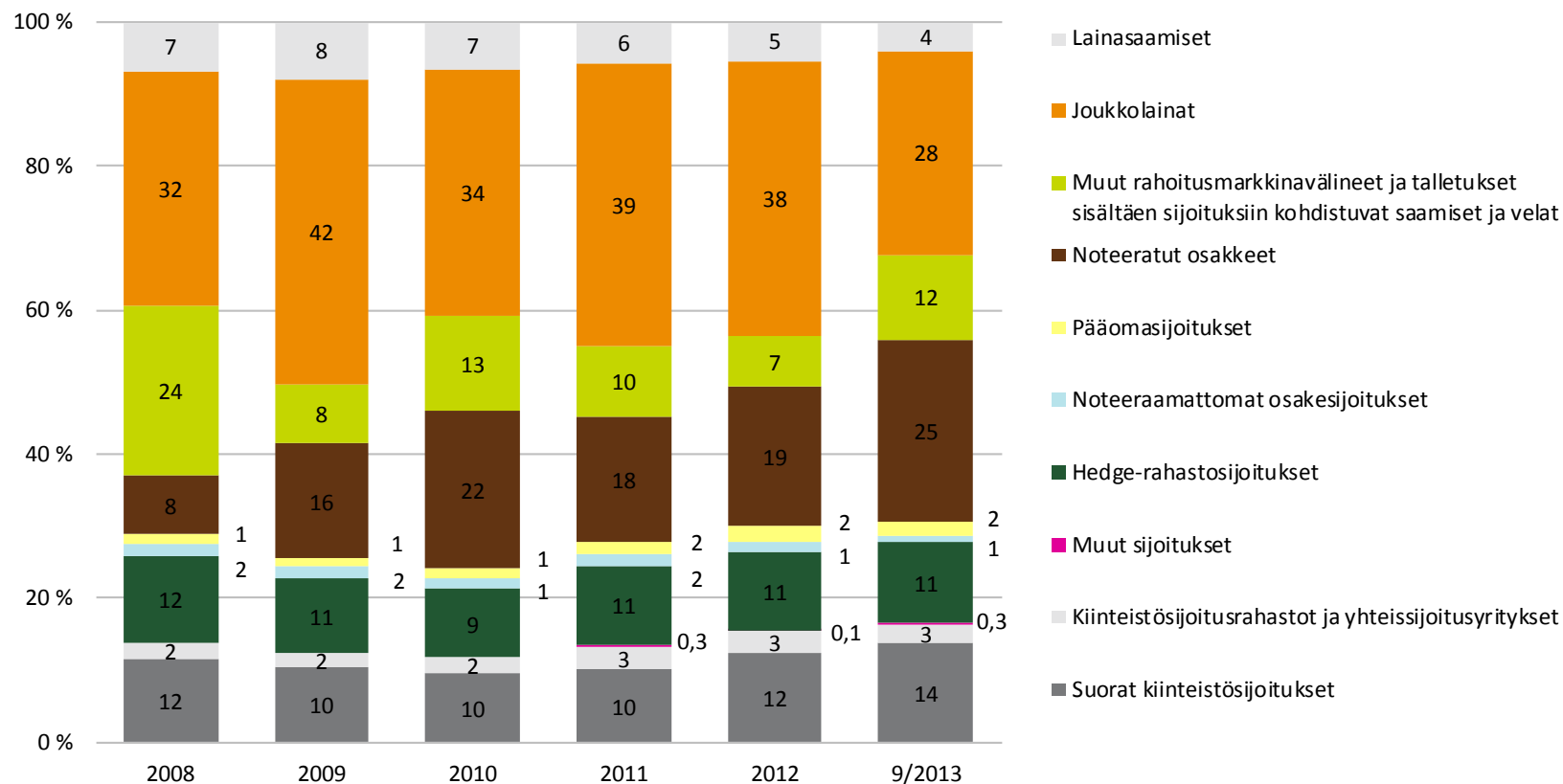




Osavuosiraportti 30.9.2013

Riskikorjattu omaisuusjakauma



Johdannaiset deltakorjattuna

Sijoitusten riskijakauma ja riskiluvut

30.9.2013

	Markkina-arvo		Riskijakauma		Tuotto	Vola
	milj. e	%	milj. e	%	%	%
Korkosijoitukset	3 463,8	43,3	3 531,9	44,2	0,6 %	
Lainasaamiset	330,0	4,1	330,0	4,1	2,3 %	
OECD/ETA-julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	561,5	7,0	492,7	6,2	0,5 %	3,7 %
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	1 754,7	22,0	1 754,7	22,0	0,5 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset sisältäen sijoituksiin kohdistuvat saamiset ja velat	817,6	10,2	954,5	11,9	0,2 %	
Osakesijoitukset	2 317,3	29,0	2 249,3	28,1	13,3 %	
Noteeratut osakkeet	2 078,4	26,0	2 010,3	25,2	14,7 %	11,8 %
Pääomasijoitukset	171,9	2,2	171,9	2,2	5,3 %	
Noteeraamattomat osakesijoitukset	67,0	0,8	67,0	0,8	0,3 %	
Kiinteistösijoitukset	1 308,3	16,4	1 308,3	16,4	13,4 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	1 093,5	13,7	1 093,5	13,7	15,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	214,8	2,7	214,8	2,7	6,5 %	
Muut sijoitukset	903,5	11,3	903,5	11,3	5,3 %	
Hedge-rahastosijoitukset	882,2	11,0	882,2	11,0	5,2 %	3,0 %
Muut sijoitukset	21,3	0,3	21,3	0,3	10,6 %	
Sijoitukset yhteensä	7 992,9	100,0	7 992,9	100,0	6,3 %	4,0 %

Markkina-arvo sisältää kertyneet korot

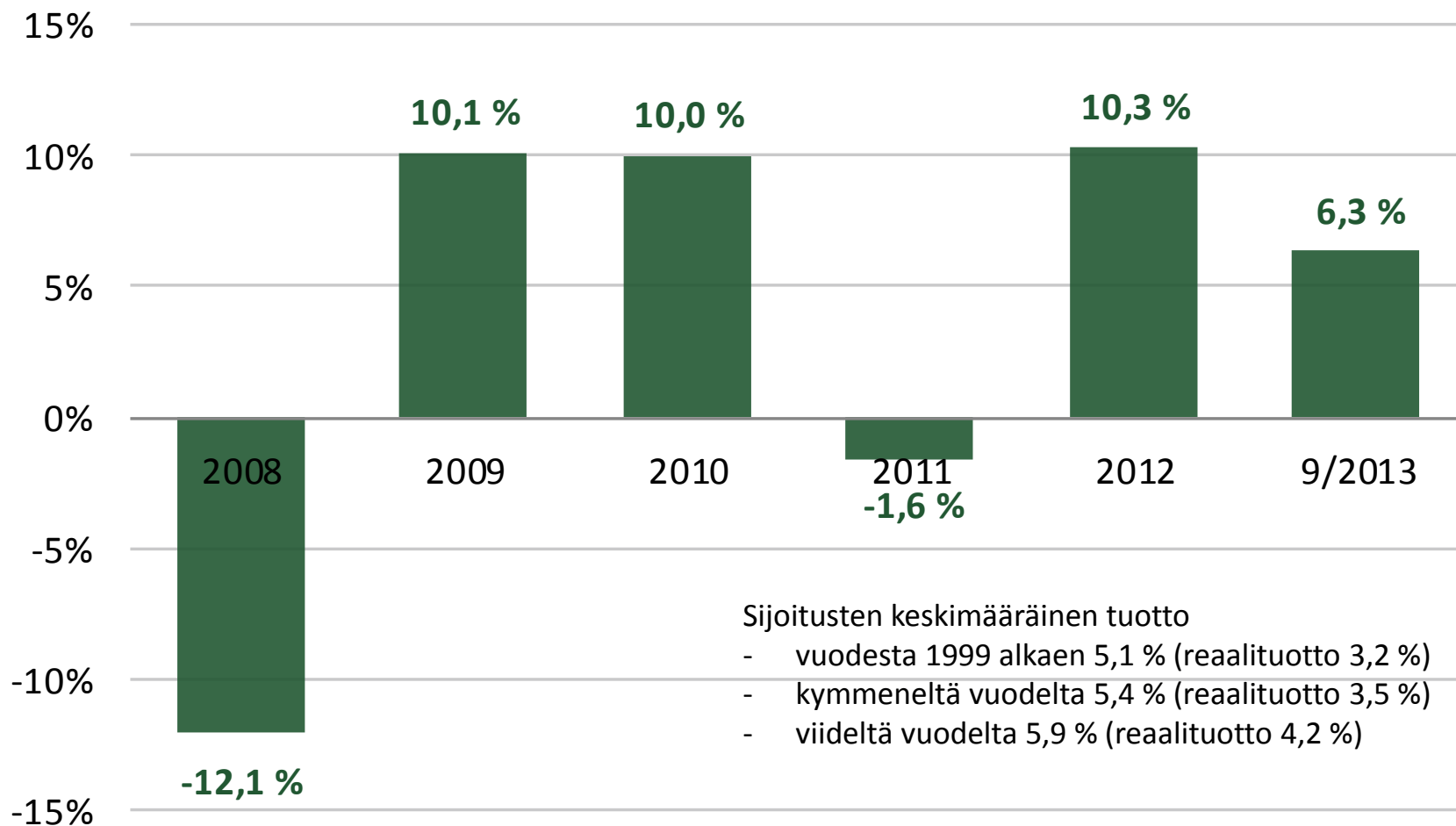
Riskijakauma = riskin mukaan laskettu (johdannaisilla oikaistu)

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

Volatiliteetti = kahden vuoden kuukausituotoista laskettu annualisoitu keskihajonta

Joukkolainojen modifioitu duraatio on 3,6 vuotta

Sijoitustuotot



Vakavaraisuus

Vakavaraisuuspääoma ja sen rajat

