

Ilmarisen osavuosisiraportti

1.1. - 30.9.2009



ILMARINEN

Sijoitustuotot riskin mukaisesti ryhmiteltynä

1.1. - 30.9.2009

	Markkina-arvo milj. e	Markkina-arvo %	Riskijakauma milj.e	Riskijakauma %	Tuotto %	Volatiliteetti
Korkosijoitukset	13 370,1	53,2	14 242,0	56,7	11,6	
Lainasaamiset	3 206,6	12,8	3 206,6	12,8	3,1	
Joukkovelkakirjalainat	8 658,0	34,4	8 681,2	34,5	16,1	4,0
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 505,6	6,0	2 354,2	9,4	1,1	
Osakesijoitukset	8 215,4	32,7	7 338,1	29,2	22,9	
Noteeratut osakkeet	7 427,8	29,5	6 550,6	26,1	29,1	26,5
Private equity -sijoitukset	490,8	2,0	490,8	2,0	-23,7	
Noteeraamattomat osakesijoitukset	296,7	1,2	296,7	1,2	1,8	
Kiinteistösijoitukset	2 531,1	10,1	2 531,1	10,1	-0,4	
Suorat kiinteistösijoitukset	2 179,1	8,7	2 179,1	8,7	4,2	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitukset	352,0	1,4	352,0	1,4	-22,6	
Muut sijoitukset	1 023,2	4,1	1 028,5	4,1	6,0	
Hedge fund -sijoitukset	561,1	2,2	561,1	2,2	8,7	8,2
Hyödykesijoitukset	2,9	0,0	8,3	0,0	-	
Muut sijoitukset	459,2	1,8	459,2	1,8	-	
Sijoitukset yhteensä	25 139,7	100,0	25 139,7	100,0	13,4	8,7

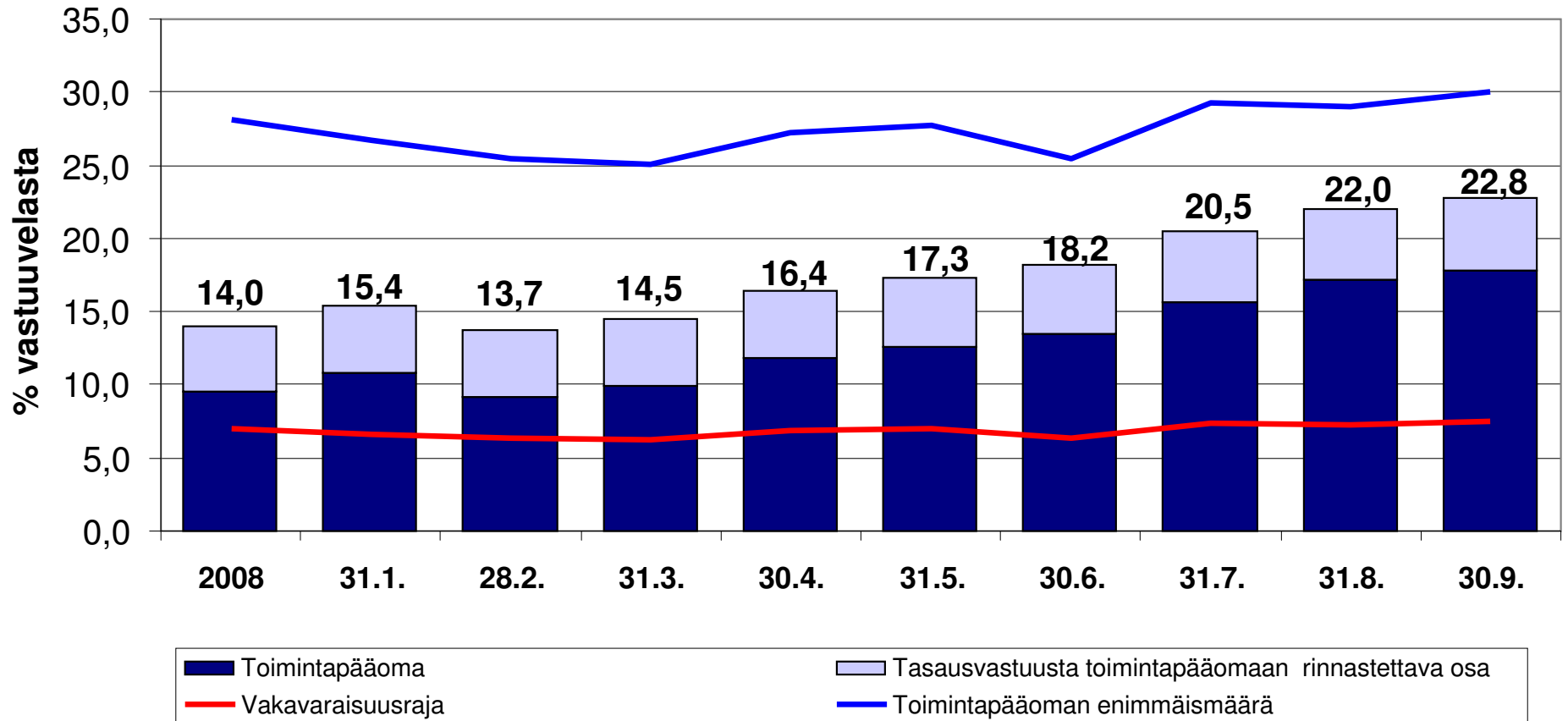
Joukkovelkakirjalainojen modifioitu duraatio on 4,2 vuotta

Volatiliteetti lasketaan kahden vuoden kuukausittaisista, logaritmisista historiatuotoista

Kokonaistuotto prosentti sisältää sijoituslajeille kohdistamattomat tuotot, kulut ja liikekulut

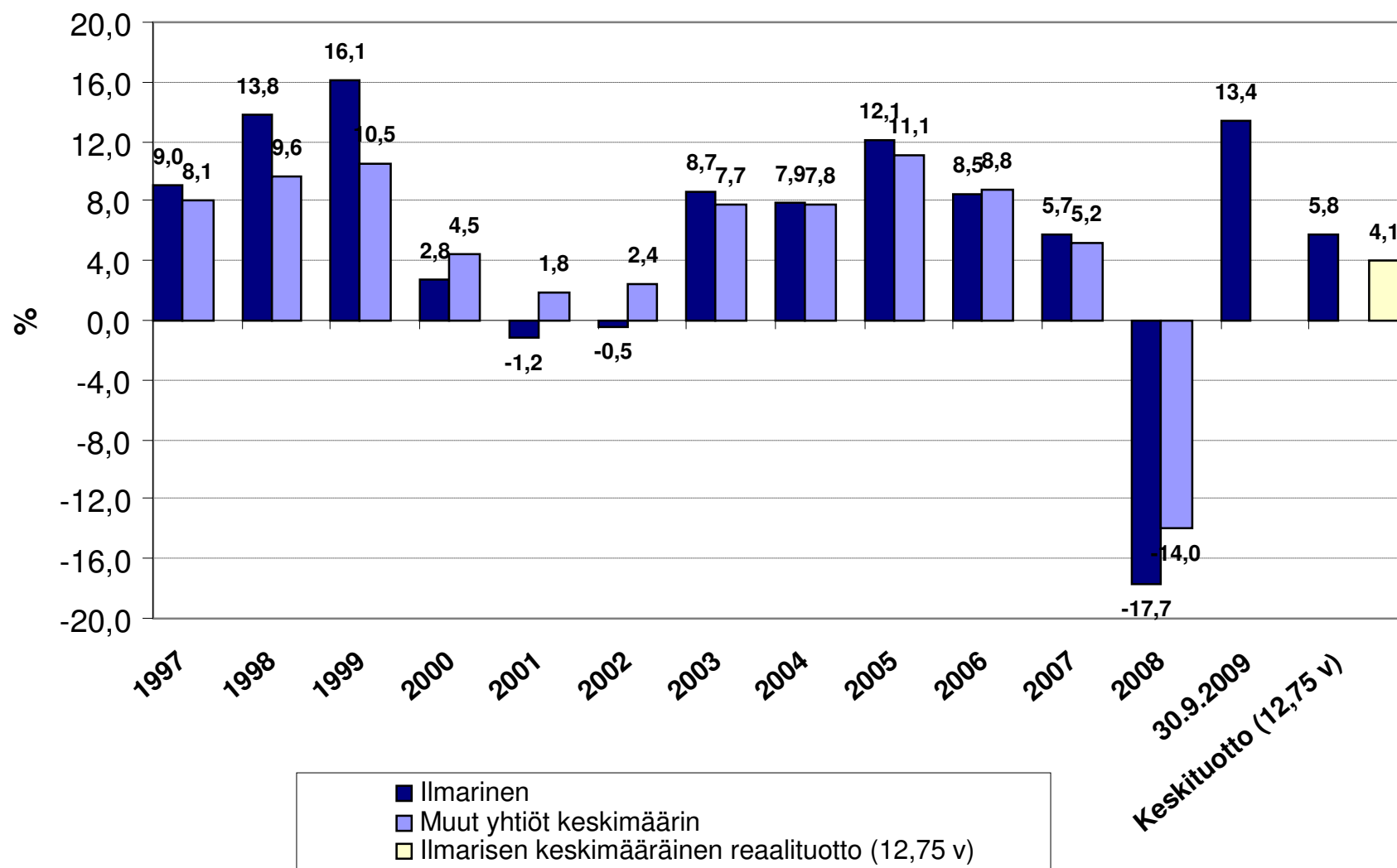
Vakavaraisuusseuranta

Toimintapääoma ja sen rajat

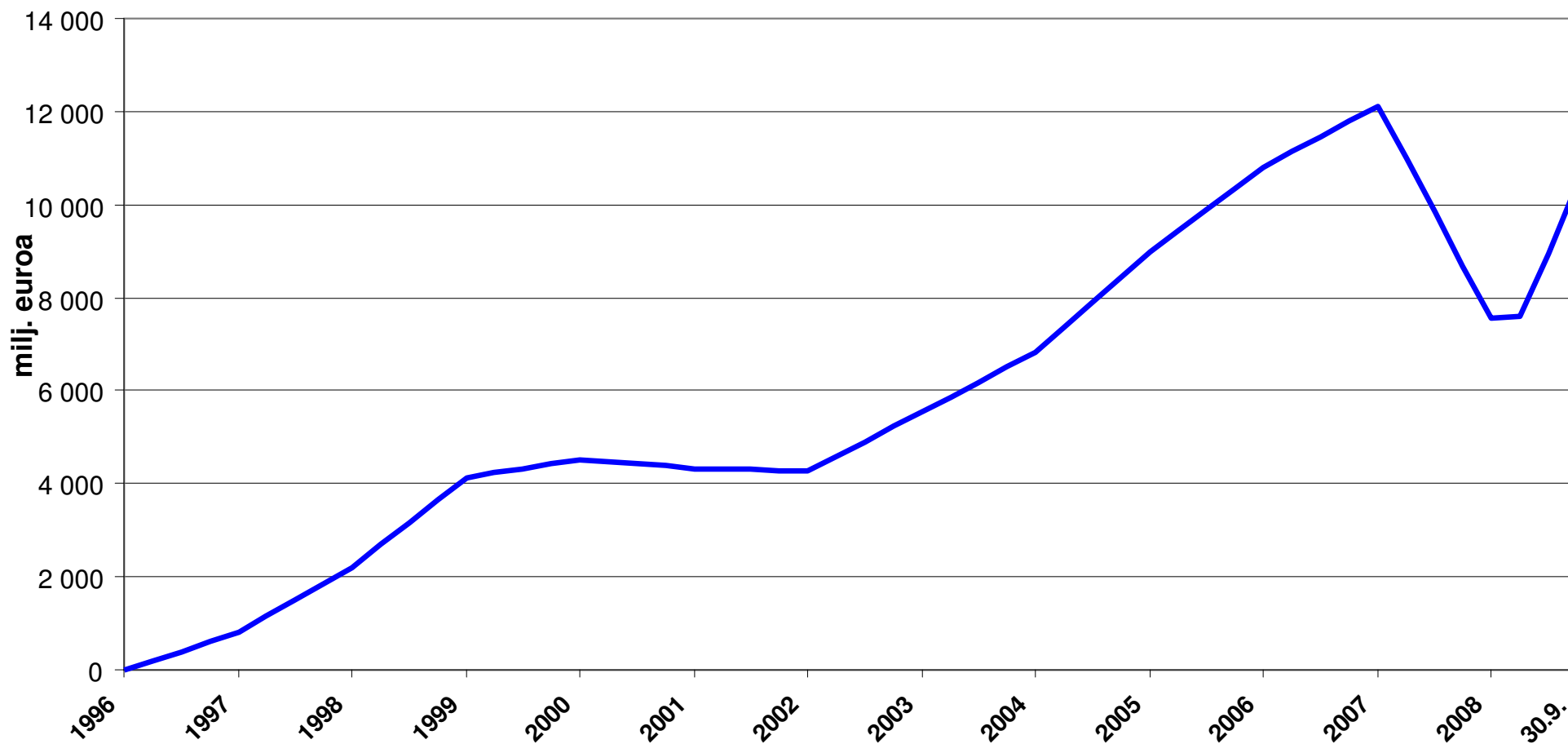


Vakavaraisuusaste oli 30.9.2009 3,0-kertainen verrattuna vakavaraisuusrajaan 7,5 %. (31.12.2008 2,0 / 7,0 %)

Sijoitusten nettotuotto 1997 - 30.9.2009



Ilmarisen sijoitustoiminnan kumulatiivinen nettotuotto, milj. euroa 1997 - 30.9.2009



Kumulatiivinen tuotto vastaa 5,8 %:n vuosittaista keskituottoa.