

Sijoitustuotot riskin mukaisesti ryhmiteltynä

Tuoton- ja riskin raportointitaulukko						
	Markkina-arvo	Markkina-arvo	Riskijakauma	Riskijakauma	Tuotto	Volatiliteetti
	milj. e	%	milj.e	%	%	%
Korkosijoitukset	12 321,5	48,5	12 567,6	49,5	1,1	
Lainasaamiset	1 258,3	5,0	1 258,3	5,0	1,2	
Joukkovelkakirjalainat	9 317,9	36,7	9 043,0	35,6	1,1	2,1
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 745,3	6,9	2 266,3	8,9	1,0	
Osakesijoitukset	9 940,6	39,1	9 417,8	37,1	-11,0	
Noteeratut osakkeet	9 155,6	36,0	8 632,7	34,0	-11,7	14,1
Private equity sijoitukset	523,9	2,1	523,9	2,1	-0,5	
Noteeraamattomat osakesijoitukset	261,2	1,0	261,2	1,0	-0,1	
Kiinteistösijoitukset	2 267,8	8,9	2 267,8	8,9	1,0	
Suorat kiinteistösijoitukset	1 948,4	7,7	1 948,4	7,7	1,2	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitukset	319,4	1,3	319,4	1,3	-0,3	
Muut sijoitukset	869,4	3,4	1 146,1	4,5	4,3	
Absoluuttisen tuoton sijoitukset	773,7	3,0	773,7	3,0	-0,5	5,4
Hyödykesijoitukset	11,5	0,0	288,3	1,1	-	
Muut sijoitukset	84,2	0,3	84,2	0,3	-	
Sijoitukset yhteensä	25 399,3	100,0	25 399,3	100,0	-4,0	4,8

Joukkovelkakirjalainojen modifioitu duraatio on 4,1 vuotta

Volatiliteetti lasketaan kahden vuoden kuukausittaisista, logaritmisista historiatuotoista

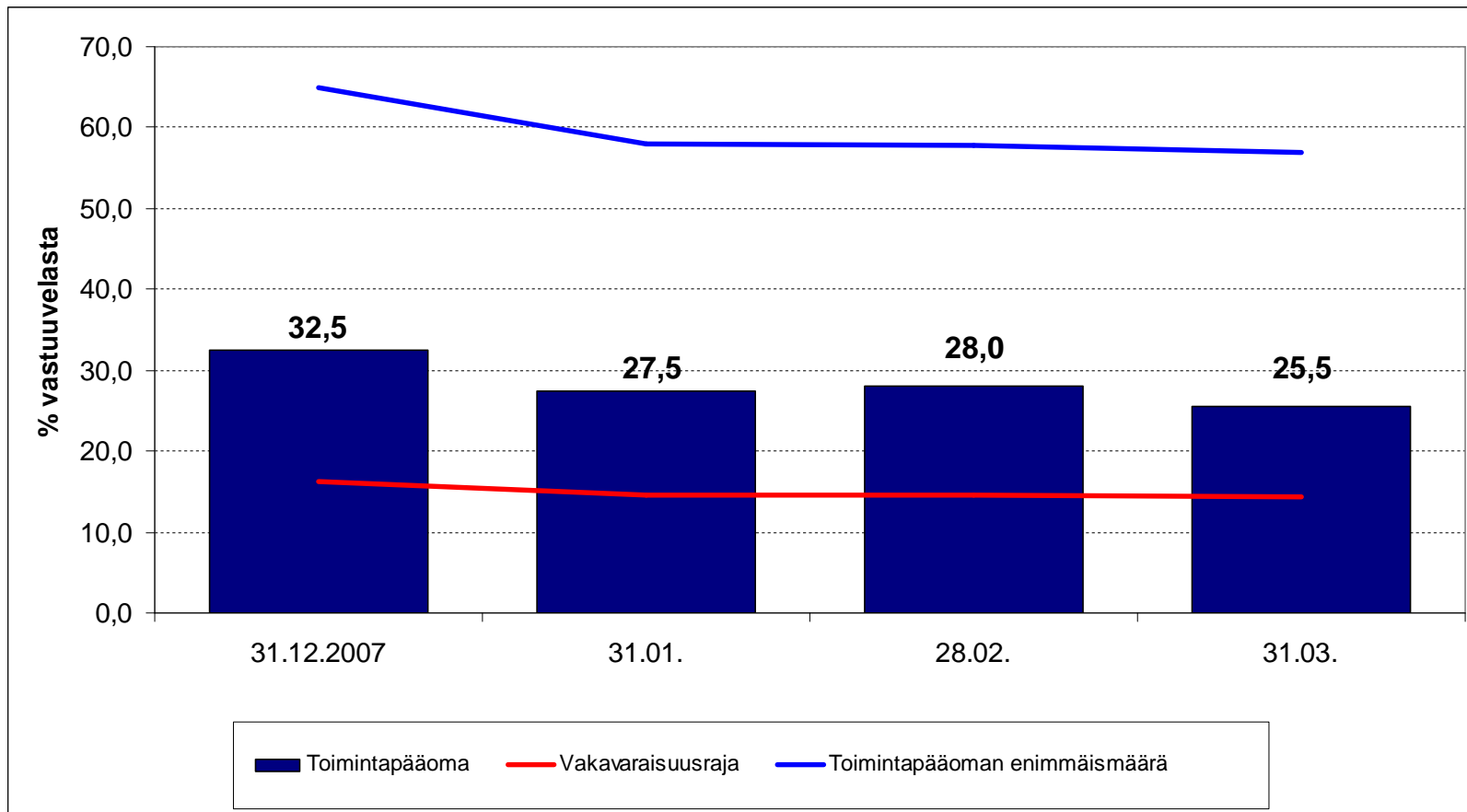
Kokonaistuotto prosentti sisältää sijoituslajeille kohdistamattomat tuotot, kulut ja liikekulut



ILMARINEN

Vakavaraisuusseuranta

Toimintapääoma ja sen rajat



Vakavaraisuusaste oli 31.3..2008 1,8-kertainen verrattuna vakavaraisuusrajaan 14,3%. (31.12.2007 2,0 / 16,3%)

Sijoitusten riskiä kuvaava VaR-luku (1 kk, 97,5 %) oli 31.3. 983,6 miljoonaa euroa. Toteutuessaan se alentaisi vakavaraisuusasteen 20,3 %:iin.