

Sijoitustuotot riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.9.2008

	Markkina-arvo milj. e	Markkina-arvo %	Riskijakauma milj. e	Riskijakauma %	Tuotto %	Volatiliteetti %
Korkosijoitukset	12 186,8	52,0	12 044,9	51,4	0,4	
Lainasaamiset	1 666,1	7,1	1 666,1	7,1	3,7	
Joukkovelkakirjalainat	9 707,5	41,4	9 406,8	40,2	-0,5	2,6
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	813,3	3,5	972,0	4,1	3,4	
Osakesijoitukset	8 031,1	34,3	7 940,7	33,9	-23,7	
Noteeratut osakkeet	7 154,6	30,5	7 064,3	30,2	-25,8	17,9
Private equity -sijoitukset	578,0	2,5	578,0	2,5	-4,4	
Noteeraamattomat osakesijoitukset	298,4	1,3	298,4	1,3	16,3	
Kiinteistösijoitukset	2 418,5	10,3	2 418,5	10,3	3,6	
Suorat kiinteistösijoitukset	1 990,4	8,5	1 990,4	8,5	4,0	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitukset	428,1	1,8	428,1	1,8	1,5	
Muut sijoitukset	787,0	3,4	1 019,3	4,4	3,8	
Hedge fund -sijoitukset	713,5	3,0	713,5	3,0	-4,9	6,6
Hyödykesijoitukset	5,2	0,0	237,5	1,0	-	
Muut sijoitukset	68,3	0,3	68,3	0,3	-	
Sijoitukset yhteensä	23 423,4	100,0	23 423,4	100,0	-9,4	6,6

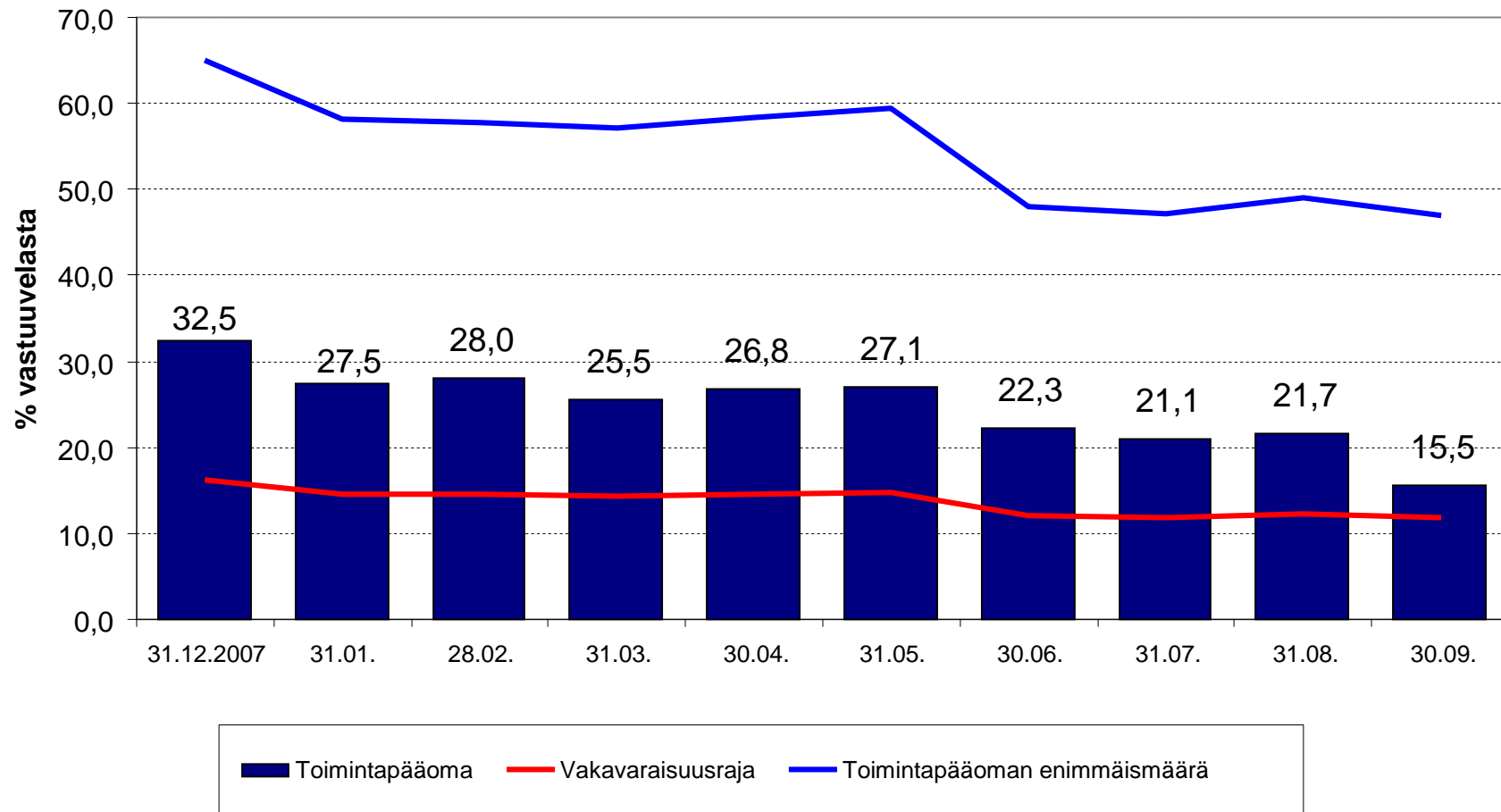
Joukkovelkakirjalainojen modifioitu duraatio on 4,0 vuotta.

Volatiliteetti lasketaan kahden vuoden kuukausittaisista, logaritmisista historiatuotoista.

Kokonaistuotto prosentti sisältää sijoituslajeille kohdistamattomat tuotot, kulut ja liikekulut.

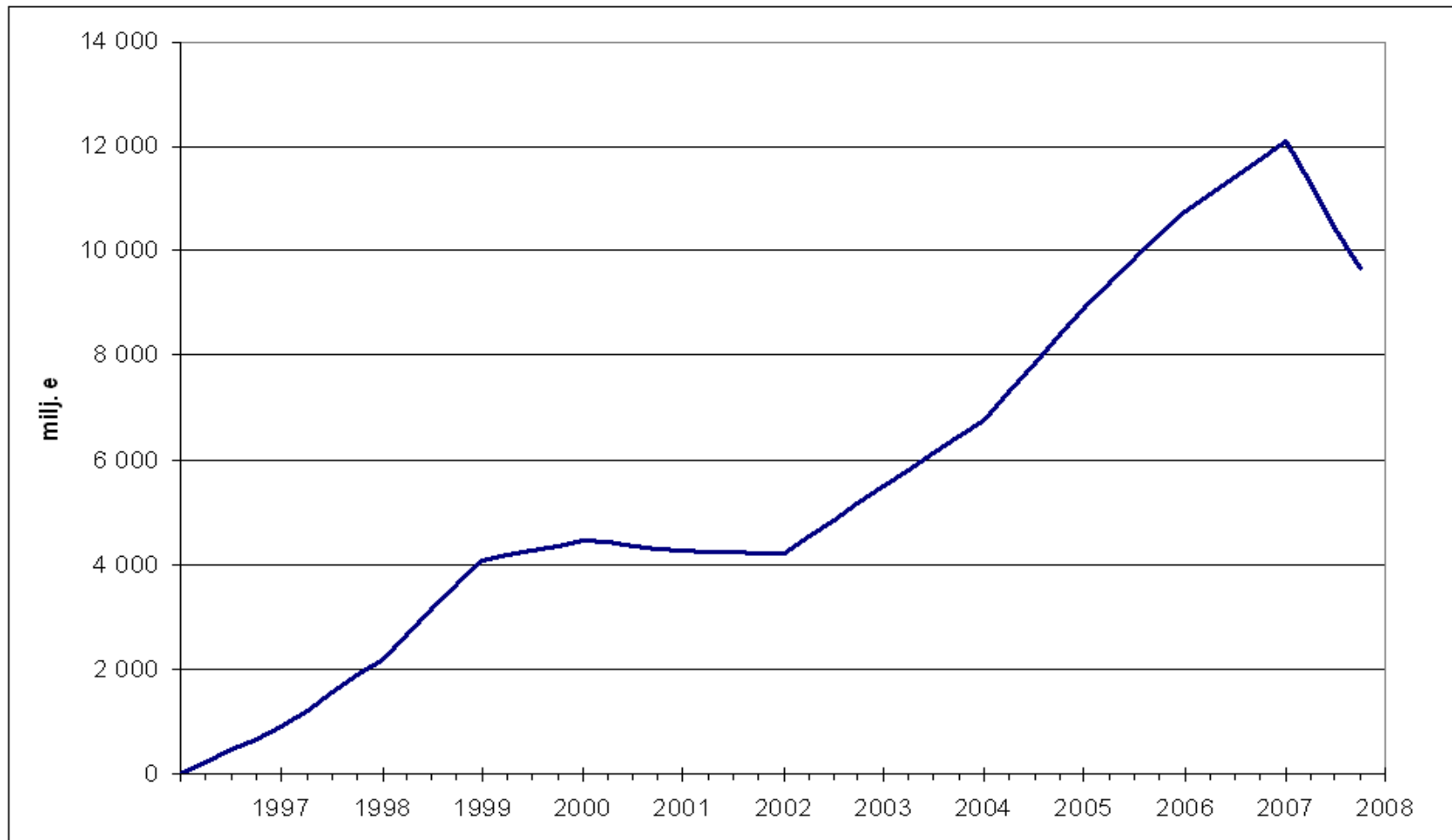
Vakavaraisuusseuranta

Toimintapääoma ja sen rajat



Vakavaraisuusaste oli 30.9.2008 1,3-kertainen verrattuna vakavaraisuusrajaan 11,7 % (31.12.2007 2,0 / 16,3 %). Sijoitusten riskiä kuvaava VaR-luku (1 kk, 97,5 %) oli 30.9. 739,4 miljoonaa euroa. Toteutuessaan se alentaisi vakavaraisuusasteen 12,0 %:iin.

Ilmarisen sijoitustoiminnan kumulatiivinen nettotuotto, milj. e 1997 - 30.9.2008



Kumulatiivinen tuotto vastaa 6,0 %:n vuosittaista keskituottoa.

Ilmarisen sijoitustoiminnan nettotuotot, % 1997 - 30.9.2008

