

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltyinä

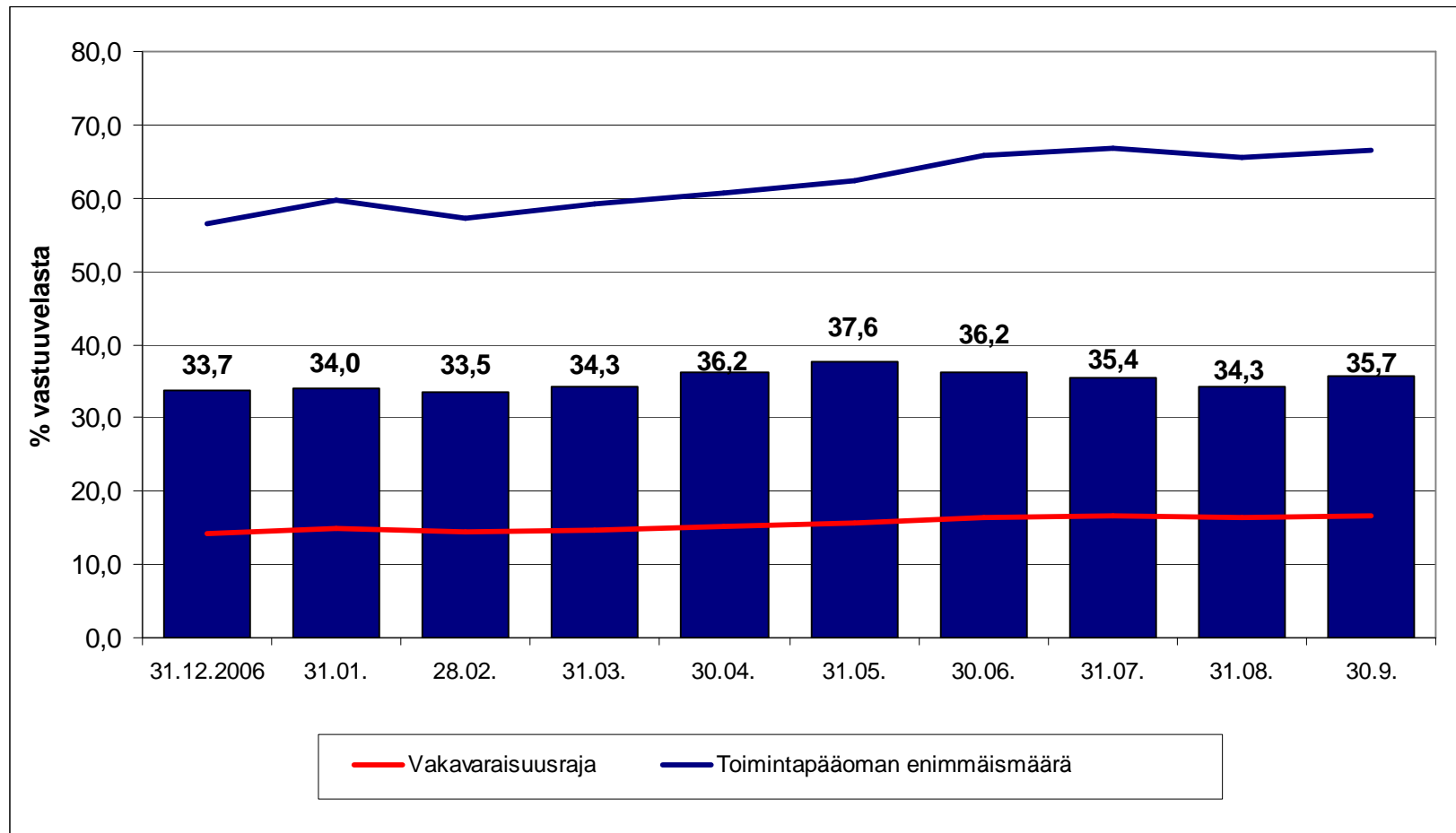
	Markkina-arvo 30.9.		Riskijakauma 30.9.		Tuotto 1.1.-30.9.	Volatiliteetti
	Milj. e	%	Milj.e	%	%	%
Korkosijoitukset	11 192,5	45,3	10 964,0	44,4	1,6	
Lainasaamiset	1 153,3	4,7	1 153,3	4,7	3,4	
Joukkovelkakirjalainat	9 709,6	39,3	9 344,9	37,8	1,3	2,1
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	329,7	1,3	465,9	1,9	2,9	
Osakesijoitukset	10 605,7	42,9	10 576,4	42,8	13,3	
Noteeratut osakkeet	10 026,8	40,6	9 997,6	40,5	12,1	10,7
Private equity sijoitukset	509,9	2,1	509,9	2,1	38,7	
Noteeraamattomat osakesijoitukset	68,9	0,3	68,9	0,3	30,0	
Kiinteistösijoitukset	2 109,0	8,5	2 109,0	8,5	4,9	
Suorat kiinteistösijoitukset	1 857,2	7,5	1 857,2	7,5	4,8	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitukset	251,8	1,0	251,8	1,0	5,6	
Muut sijoitukset	806,6	3,3	1 064,2	4,3	21,0	
Absoluuttisen tuoton sijoitukset	759,3	3,1	759,3	3,1	13,7	4,5
Hyödykesijoitukset	15,7	0,1	273,0	1,1	-	
Muut sijoitukset	31,6	0,1	32,0	0,1	-	
Sijoitukset yhteensä	24 713,7	100,0	24 713,7	100,0	6,8	3,5

Joukkovelkakirjalainojen modifioitu duraatio on 4,0 vuotta.

Volatiliteetti lasketaan kahden vuoden kuukausittaisista, logaritmisista historiatuotoista.

Vakavaraisuusseuranta

Toimintapääoma ja sen rajat



Vakavaraisuusaste oli 30.9.2007 2,1-kertainen verrattuna vakavaraisuusrajaan 16,6 %. (31.12.2006 2,4 / 14,1%)
 Sijoitusten riskiä kuvaava VaR-luku (1 kk, 97, 5 %) oli 987 milj. euroa. Toteutuessaan se alentaisi vakavaraisuusasteen 29,8 %:iin.