



Veritas Eläkevakuutus Tulosraportti1–3/2013

Sijoitukset ja sijoitustuotot riskin mukaan ryhmiteltyinä

	Markkina-arvo M€ ¹⁾	Todellinen riskiasema M€ ¹⁾	Todellinen riskiasema %	Sitoutuneen pääoman tuotto, %	Volatiliteetti % (24kk)
Korkosijoitukset	1 092,9	1 092,9	46,3	0,8	
Lainat	32,8	32,8	1,4	0,4	
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat ²⁾	216,6	136,6	5,8	-0,8	3,7 ³⁾
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	783,2	783,2	33,2	1,4	
Muut rahoitusvälineet ja talletukset sisältäen sijoitustoiminnan saatavat ja velat	60,4	140,3	6,0	0,1	
Osakesijoitukset	780,7	780,7	33,1	5,8	
Noteeratut osakkeet	671,6	671,6	28,5	6,5	17,6
Pääomasijoitukset	66,0	66,0	2,8	1,5	
Noteeraamattomat osakkeet	43,0	43,0	1,8	1,5	
Kiinteistöt	429,8	429,8	18,2	1,5	
Suorat kiinteistösijoitukset	368,9	368,9	15,6	1,6	
Kiinteistösijoitusrahastot	60,9	60,9	2,6	0,6	
Muut sijoitukset	54,8	54,8	2,3	-1,4	
Hedge-rahastot	10,1	10,1	0,4	2,5	7,1
Muut sijoitukset	44,6	44,6	1,9	-2,2	
Yhteensä	2 358,1	2 358,1	100,0	2,4	5,7

1) Sisältää kertyneet korot

2) Sisältää OECD- ja ETA-alueen julkisyhteisöjen liikkeeseen laskemat tai takaamat joukkovelkakirjat.

3) Volatiliteetti on laskettu kaikista joukkovelkakirjalainoista (ei ainoastaan julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainoista). Kaikkien joukkovelkakirjojen modifioitu duraatio on 3,8.

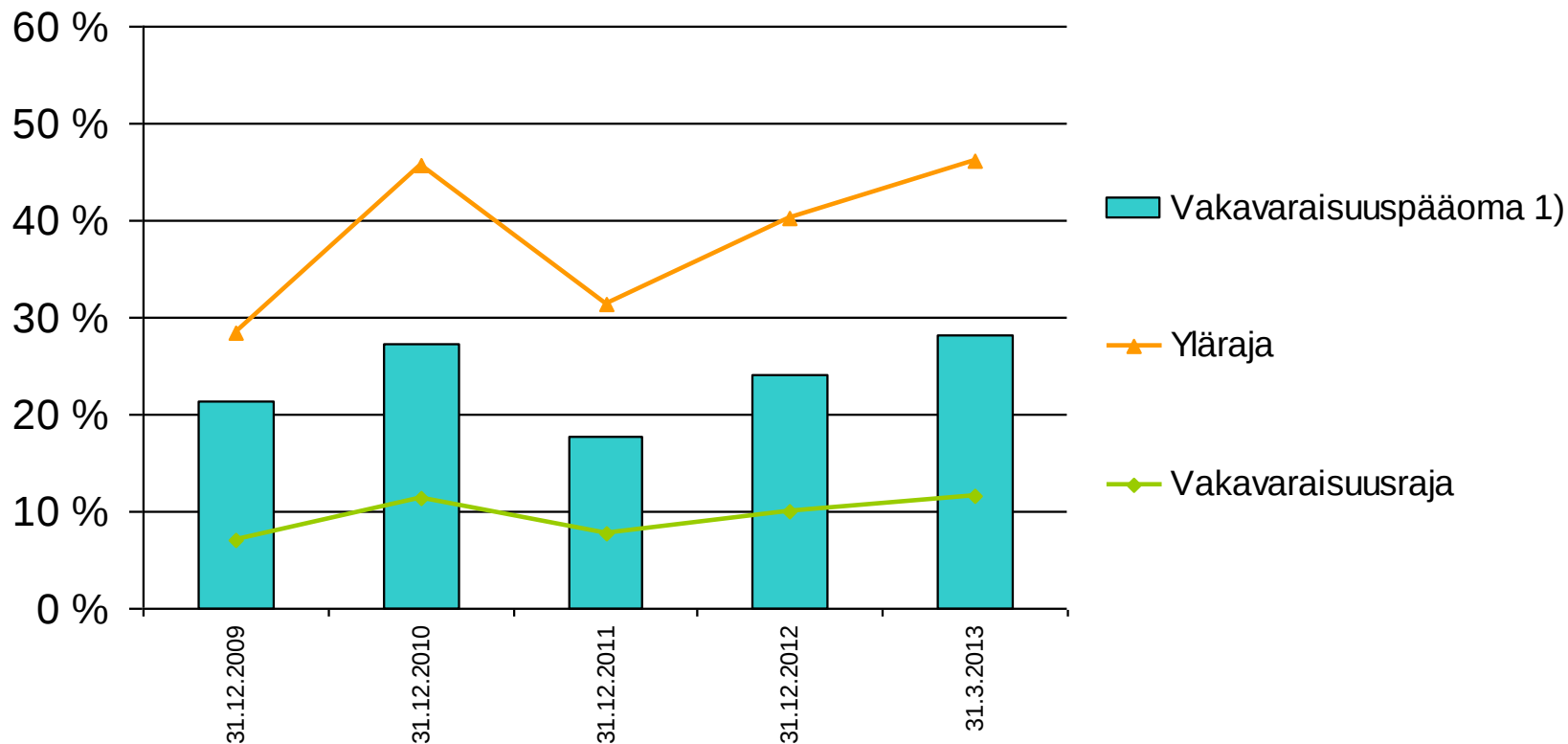
Vakavaraisuus

	31.3.2013	31.12.2012
Vakavaraisuuspääoma, milj. € ¹⁾	524,5	452,7
% vastuuelasta ²⁾	28,1	24,1
suhteessa vakavaraisuusrajaan	2,4	2,4
Vakavaraisuusraja (% vastuuelasta) ²⁾	11,6	10,1

1) 31.3.2013 = vakavaraisuuspääoma, joka sisältää myös tasoitusvastuun 123,7 m€; 31.12.2012 = toimintapääoma, joka sisältää myös tasausvastuusta toimintapääomaan rinnastettavan erän (78,3 m€)

2) Suhdeluku laskettuna %:na vakavaraisuusrajan laskennassa käytetystä vastuuelasta.

Vakavaraisuuden kehitys



1) Toimintapääomaa (sis. tasoitusvastuusta toimintapääomaan rinnastettavan erän 2008-2012) 31.12.2012 asti.
Vakavaraisuuspääomaa 1.1.2013 alkaen sisältäen tasoitusvastuun.