



SIJOITUSTOIMINNAN AVAINLUKUTAULUKOT

Veritas Eläkevakuutus
Osavuositulos 1–6/2016



SIJOITUKSET JA SIJOITUSTUOTOT KÄYVIN ARVOIN

	Perusjakauma						Riskijakauma						Tuotto			Volatiliteetti
	30.6.2016		30.6.2015		31.12.2015		30.6.2016		30.6.2015		31.12.2015		1-6/2016	1-6/2015	2015	(24 kk)
	milj. €	%	milj. €	%	milj. €	%	milj. €	% ^a	milj. €	%	milj. euro	% ^b	%	%	%	%
Korkosijoitukset	1 267,2	45,4	1 165,9	42,2	1 287,8	46,7	1 090,8	39,0	1 160,4	42,0	1 273,9	46,2	2,4	1,1	0,4	
Lainasaamiset ¹	36,9	1,3	37,0	1,3	40,8	1,5	36,9	1,3	37,0	1,3	40,8	1,5	1,1	2,3	-0,6	
Joukkovelkakirjalainat	1 020,8	36,5	1 013,7	36,6	1 062,2	38,5	792,8	28,4	1 008,1	36,4	1 048,3	38,0	3,0	1,2	0,5	3,0
<i>Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat</i>	<i>302,4</i>	<i>10,8</i>	<i>251,6</i>	<i>9,1</i>	<i>318,7</i>	<i>11,6</i>	<i>126,0</i>	<i>4,5</i>	<i>246,0</i>	<i>8,9</i>	<i>304,8</i>	<i>11,1</i>	<i>1,8</i>	<i>-1,2</i>	<i>1,0</i>	
<i>Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat</i>	<i>718,4</i>	<i>25,7</i>	<i>762,1</i>	<i>27,6</i>	<i>743,5</i>	<i>27,0</i>	<i>666,8</i>	<i>23,9</i>	<i>762,1</i>	<i>27,6</i>	<i>743,5</i>	<i>27,0</i>	<i>3,6</i>	<i>2,0</i>	<i>0,3</i>	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset ¹²	209,6	7,5	115,2	4,2	184,7	6,7	261,1	9,3	115,2	4,2	184,7	6,7	0,0	0,0	0,1	
Osakesijoitukset	969,5	34,7	973,2	35,2	964,6	35,0	969,5	34,7	973,2	35,2	974,4	35,4	-1,2	12,9	12,3	
Noteeratut osakkeet	803,2	28,7	810,0	29,3	793,6	28,8	803,2	28,7	810,0	29,3	803,4	29,2	-2,2	13,3	10,8	12,2
Pääomasijoitukset ³	118,2	4,2	104,1	3,8	112,8	4,1	118,2	4,2	104,1	3,8	112,8	4,1	1,1	11,8	20,9	
Noteeraamattomat osakkeet ⁴	48,1	1,7	59,0	2,1	58,2	2,1	48,1	1,7	59,0	2,1	58,2	2,1	9,2	9,2	16,1	
Kiinteistösijoitukset	286,1	10,2	427,4	15,5	304,3	11,0	286,1	10,2	427,4	15,5	304,3	11,0	2,3	5,0	10,3	
Suorat kiinteistösijoitukset	213,7	7,6	374,6	13,5	198,6	7,2	213,7	7,6	374,6	13,5	198,6	7,2	2,0	5,4	7,8	
Kiinteistösijoitusrahastot	72,4	2,6	52,8	1,9	105,6	3,8	72,4	2,6	52,8	1,9	105,6	3,8	3,0	2,0	25,6	
Muut sijoitukset	271,3	9,7	199,5	7,2	199,1	7,2	271,3	9,7	199,5	7,2	199,1	7,2	-0,3	3,6	3,1	3,4
Hedge-rahastosijoitukset ⁵	137,2	4,9	136,0	4,9	135,8	4,9	137,2	4,9	136,0	4,9	135,8	4,9	-2,2	2,7	1,5	
Muut sijoitukset ⁶	134,1	4,8	63,5	2,3	63,4	2,3	134,1	4,8	63,5	2,3	63,4	2,3	3,2	5,9	7,0	
Sijoitukset yhteensä	2 794,1	100,0	2 766,0	100,0	2 755,8	100,0	2 617,7	93,7	2 760,4	99,8	2 751,7	99,9	0,9	5,8	5,8	4,4
Johdannaisten vaikutus ⁷							176,4	6,3	5,6	0,2	4,1	0,1				
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä							2 794,1	100,0	2 766,0	100,0	2 755,8	100,0				
Jvk-salkun modifioitu duraatio							3,2									

¹ Sisältää kertyneet korot

² Sisältää rahat ja pankkisaamiset sekä kauppahintasaamiset ja -velat

³ Sisältää pääoma- ja mezzanine-rahastot

⁴ Sisältää noteeraamattomat kiinteistösijoitusyhtiöt

⁵ Sisältää kaikenlaiset hedge-rahasto-osuudet riippumatta rahaston strategiasta

⁶ Sisältää erät, joita ei voida kohdistaa muihin sijoituslajeihin

⁷ Sisältää johdannaisten vaikutuksen riski- ja perusjakauman erotukseen. Johdannaisten vaikutus voi olla +/- Eron korjauksen jälkeen riskijakauman loppusumma täsmää perusjakaumaan.

⁸ Suhteellinen osuus lasketaan käyttäen jakajana "Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä" -ravin loppusummaa.

Taulukko on laadittu Työeläkevakuuttajat Tela ry:n suositusten mukaisesti.



SIJOITUSTOIMINNAN NETTOTUOTTO SITOUTUNEELLE PÄÄOMALLE

	Sijoitustoim. nettotuotot, markkina- arvo ⁷	Sitoutunut pääoma ⁸	Tuotto-% sitoutuneelle pääomalle	Tuotto-% sitoutuneelle pääomalle	Tuotto-% sitoutuneelle pääomalle
	1.1 - 30.06.2016 milj. €	1.1 - 30.06.2016 milj. €	%	1.1.-30.6.2015 %	1.1 - 31.12.2015 %
Korkosijoitukset	31,7	1 314,5	2,4 %	1,1 %	0,4 %
Lainasaamiset ¹	0,5	42,0	1,1 %	2,3 %	-0,6 %
Joukkovelkakirjalainat	31,3	1 042,7	3,0 %	1,2 %	0,5 %
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset ^{1 2}	0,0	229,9	0,0 %	0,0 %	0,1 %
Osakesijoitukset	-11,7	966,3	-1,2 %	12,9 %	12,3 %
Noteeratut osakkeet	-17,6	800,4	-2,2 %	13,3 %	10,8 %
Pääomasijoitukset ³	1,3	115,1	1,1 %	11,8 %	20,9 %
Noteeraamattomat osakkeet ⁴	4,7	50,8	9,2 %	9,2 %	16,1 %
Kiinteistösijoitukset	6,4	281,5	2,3 %	5,0 %	10,3 %
Suorat kiinteistösijoitukset	4,1	200,4	2,0 %	5,4 %	7,8 %
Kiinteistösijoitusrahastot	2,3	81,1	3,0 %	2,0 %	25,6 %
Muut sijoitukset	-0,6	221,8	-0,3 %	3,6 %	3,1 %
Hedge-rahastosijoitukset ⁵	-3,1	143,1	-2,2 %	2,7 %	1,5 %
Muut sijoitukset ⁶	2,5	78,7	3,2 %	5,9 %	7,0 %
Sijoitukset yhteensä	25,9	2 784,2	0,9 %	5,8 %	5,9 %
Sijoituslajeille kohdistamattomat tuotot, kulut ja liikekulut	-2,2		-0,1 %	-0,1 %	-0,2 %
Sijoitustoiminnan nettotuotto käyvin arvo	23,7		0,9 %	5,8 %	5,8 %

¹ Sisältää kertyneet korot

² Sisältää rahat ja pankkisaamiset sekä kauppahintasaamiset ja -velat

³ Sisältää pääoma- ja mezzanine-rahastot

⁴ Sisältää noteeraamattomat kiinteistösijoitusyhtiöt

⁵ Sisältää kaikenlaiset hedge-rahasto-osuudet riippumatta rahaston strategiasta

⁶ Sisältää erät, joita ei voida kohdistaa muihin sijoituslajeihin

⁷ Raportointikauden lopun ja alun markkina-arvojen muutos - kauden aikana tapahtuneet kassavirrat

Kassavirralla tarkoitetaan myyntien/tuottojen ja ostojen/kulujen erotusta.

⁸ Sitoutunut pääoma = markkina-arvo raportointikauden alussa + päivittäin/kuukausittain aikapainotetut kassavirrat



TACK/KIITOS

Följ oss: www.veritas.fi/sv/some

Seuraa meitä: www.veritas.fi/some

