

14 Rahoitusvarat

Konsernin rahoitusvarat koostuvat sijoituksista johdannaissopimuksiin, käypään arvoon tulosvaikutteisesti kirjattavaksi määritetyistä rahoitusvaroista, lainoista ja muista saamisista sekä myytävissä olevista rahoitusvaroista. Omistusyhteisösegmentti sisältää lisäksi sijoitukset tytäryhtiöosakkeisiin.

Johdannaissopimuksia konsernissa voidaan tehdä sekä kaupankäynti- että suojaamistarkoituksessa. Käytettäviä instrumentteja ovat valuutta-, korko- ja osakejohdannaiset. Käyvän arvon suojausta on sovellettu tilikaudella vain Mandatumissa.

Milj. e	2017	2016
If		
Johdannaissopimukset	25	14
Lainat ja muut saamiset	83	84
Myytävissä olevat rahoitusvarat	11 109	11 569
If yhteensä	11 217	11 667
Topdanmark		
Johdannaissopimukset	16	-
Kaupankäyntivarat	5 692	
Lainat ja muut saamiset	458	-
Topdanmark yhteensä	6 166	-
Mandatum		
Johdannaissopimukset	31	13
Käypään arvoon tulosvaikutteisesti kirjattavaksi määritetyt rahoitusvarat	-	24
Lainat ja muut saamiset	0	20
Myytävissä olevat rahoitusvarat	5 144	5 612
Yhteensä	5 176	5 670
Myytävänä olevat rahoitusvarat	-198	-210
Mandatum yhteensä	4 977	5 459
Omistusyhteisö		
Johdannaissopimukset	13	18
Lainat ja muut saamiset	0	0
Myytävissä olevat rahoitusvarat	729	814
Sijoitukset tytäryhtiöissä	3 767	2 370
Omistusyhteisö yhteensä	4 510	3 201
Segmenttien väliset eliminoinnit	-4 038	-2 659
Konsernin rahoitusvarat yhteensä	22 832	17 668

Johdannaissopimukset

Milj. e	2017			2016		
	Kohde-et. nimell.arvo	Käypä arvo Saamiset	Velat	Kohde-et. nimell.arvo	Käypä arvo Saamiset	Velat
Kaupankäyntitarkoituksessa pidettävät johdannaissopimukset						
Korkojohdannaiset						
OTC-johdannaiset						
Koronvaihtosopimukset	2 836	6	77	735	12	4
Valuuttajohdannaiset						
OTC-johdannaiset						
Valuuttatermiinit	11 131	74	18	5 317	27	75
Valuuttaoptiot, ostetut ja myydyt	188	2	1	92	0	0
Valuuttajohdannaiset yhteensä	11 319	76	18	5 409	27	75

Osakejohdannaiset						
OTC-johdannaiset						
Osake- ja osakeindeksiopiot	0	0	0	9	3	3
Osakefutuurit	44	0	0	-	-	-
Osakejohdannaiset yhteensä	44	0	0	9	3	3
Kaupankäyntitarkoituksessa pidettävät johdannaissopimukset yhteensä	14 199	82	96	6 153	43	81
Suojaavat johdannaissopimukset						
Käypää arvoa suojaavat						
Valuuttatermiinit	364	3	0	534	2	0
Suojaavat johdannaissopimukset yhteensä	364	3	0	534	2	0
Konsernin johdannaissopimukset yhteensä	14 563	85	96	6 687	45	81

Käyvän arvon suojaus

Käyvän arvon suojausta käytetään Mandatumissa suojaamaan osaa myytävissä olevien rahoitusvarojen valuuttariskistä. Suojaussuhteen ulkopuolelle on jätetty termiinisopimusten korkoelementti. Käyvän arvon suojausiksi luokiteltujen valuuttajohdannaisten nettotulos oli -63 (19) milj. euroa. Suojattavasta riskistä johtuva nettotulos myytävissä olevien rahoitusvarojen käyvän arvon suojauksesta oli 63 (-19) milj. euroa.

Muut rahoitusvarat

Milj. e	2017	2016
Käypään arvoon tulosvaikutteisesti kirjattavaksi määritetyt rahoitusvarat		
Saamistodistukset	4 628	22
Osakkeet ja osuudet	793	2
Käypään arvoon tulosvaikutteisesti kirjattavaksi määritetyt rahoitusvarat yhteensä	5 422	24
Lainat ja muut saamiset	542	104
Myytävissä olevat rahoitusvarat		
Saamistodistukset	13 081	13 503
Osakkeet ja osuudet	3 902	4 202
Myytävissä olevat rahoitusvarat yhteensä	16 982	17 705

Myytävissä olevat arvopaperit sisältävät arvonalentumistappioita 288 milj. euroa (242).

Konsernin muut rahoitusvarat yhteensä	22 945	17 833
Mandatumin myytävänä olevat omaisuuserät	-198	-210
Milj. e	2017	2016
Konsernin rahoitusvarat yhteensä	22 832	17 668