

## Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltyinä 30.9.2022 1)

|   | Perusjakauma                      |                | Riskijakauma    |                | MWR-tuotto 2)  | Volatiliteetti 3) |
|---|-----------------------------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|-------------------|
|   | MEUR                              | %              | MEUR            | %              |                |                   |
| <b>Korkosijoitukset</b>                               | <b>8 387,6</b>                    | <b>39,4 %</b>  | <b>8 532,3</b>  | <b>40,1 %</b>  | <b>-7,9 %</b>  |                   |
| Lainasaamiset   | 688,5                             | 3,2 %          | 688,5           | 3,2 %          | 0,8 %          |                   |
| Joukkovelkakirjalainat                                | 6 766,7                           | 31,8 %         | 6 911,3         | 32,5 %         | -10,1 %        | 4,4 %             |
| Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat               | 3 623,5                           | 17,0 %         | 3 550,3         | 16,7 %         | -5,9 %         |                   |
| Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat              | 3 143,1                           | 14,8 %         | 3 361,1         | 15,8 %         | -14,4 %        |                   |
| Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset          | 932,5                             | 4,4 %          | 932,5           | 4,4 %          | 0,1 %          |                   |
| <b>Osakesijoitukset</b>                               | <b>10 884,2</b>                   | <b>51,2 %</b>  | <b>10 647,6</b> | <b>50,1 %</b>  | <b>-11,3 %</b> |                   |
| Noteeratut osakkeet                                   | 8 457,8                           | 39,8 %         | 8 221,2         | 38,7 %         | -16,1 %        | 14,4 %            |
| Pääomasijoitukset                                     | 2 152,2                           | 10,1 %         | 2 152,2         | 10,1 %         | 12,3 %         |                   |
| Noteeraamattomat osakkeet                             | 274,2                             | 1,3 %          | 274,2           | 1,3 %          | 6,9 %          |                   |
| <b>Kiinteistösijoitukset</b>                          | <b>947,1</b>                      | <b>4,5 %</b>   | <b>947,1</b>    | <b>4,5 %</b>   | <b>5,0 %</b>   |                   |
| Suorat kiinteistösijoitukset                          | 0,0                               | 0,0 %          | 0,0             | 0,0 %          | 0,0 %          |                   |
| Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusryitykset | 947,1                             | 4,5 %          | 947,1           | 4,5 %          | 5,0 %          |                   |
| <b>Muut sijoitukset</b>                               | <b>1 046,2</b>                    | <b>4,9 %</b>   | <b>1 046,2</b>  | <b>4,9 %</b>   | <b>5,2 %</b>   |                   |
| Hedge-rahastosijoitukset                              | 1 045,5                           | 4,9 %          | 1 045,5         | 4,9 %          | 5,3 %          | 3,5 %             |
| Hyödykesijoitukset                                    | 0,0                               | 0,0 %          | 0,0             | 0,0 %          | 0,0 %          |                   |
| Muut sijoitukset                                      | 0,7                               | 0,0 %          | 0,7             | 0,0 %          |                |                   |
| <b>Sijoitukset yhteensä</b>                           | <b>21 265,1</b>                   | <b>100,0 %</b> | <b>21 173,2</b> | <b>99,6 %</b>  | <b>-8,7 %</b>  | <b>7,8 %</b>      |
| Johdannaisten vaikutus                                |                                   |                | 91,9            | 0,4 %          |                |                   |
| <b>Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä</b>             | <b>21 265,1</b>                   | <b>100,0 %</b> | <b>21 265,1</b> | <b>100,0 %</b> |                |                   |
| <b>Jvk-salkun modifioitu duraatio</b>                 | <b>4,1 vuotta</b>                 |                |                 |                |                |                   |
| <b>Avoin valuuttapositio on</b>                       | <b>39,7 % sijoitusten arvosta</b> |                |                 |                |                |                   |

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

3) Sijoitusten volatiliteetti laskettu kuukausihavainnoista 24 kk:n ajanjaksolta.