

## Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.9.2018 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto	Volatiliteetti
	MEUR	%	MEUR	%	2) %	3) %
<b>Korkosijoitukset</b>	<b>8 067,3</b>	<b>41,1 %</b>	<b>7 372,3</b>	<b>37,5 %</b>	<b>-1,3 %</b>	
Lainasaamiset	399,4	2,0 %	399,4	2,0 %	4,9 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 532,5	33,2 %	5 837,5	29,7 %	-2,0 %	2,1 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 449,8	17,6 %	2 754,9	14,0 %	-2,6 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 082,6	15,7 %	3 082,6	15,7 %	-1,3 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 135,4	5,8 %	1 135,4	5,8 %	0,5 %	
<b>Osakesijoitukset</b>	<b>9 767,3</b>	<b>49,7 %</b>	<b>9 697,5</b>	<b>49,3 %</b>	<b>5,1 %</b>	
Noteeratut osakkeet	8 852,8	45,0 %	8 783,0	44,7 %	4,6 %	6,0 %
Pääomasijoitukset	731,1	3,7 %	731,1	3,7 %	11,2 %	
Noteeraamattomat osakkeet	183,4	0,9 %	183,4	0,9 %	5,6 %	
<b>Kiinteistösijoitukset</b>	<b>874,7</b>	<b>4,5 %</b>	<b>874,7</b>	<b>4,5 %</b>	<b>4,7 %</b>	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusryitykset	874,7	4,5 %	874,7	4,5 %	4,7 %	
<b>Muut sijoitukset</b>	<b>943,0</b>	<b>4,8 %</b>	<b>913,1</b>	<b>4,6 %</b>	<b>-1,9 %</b>	
Hedge-rahastosijoitukset	746,0	3,8 %	746,0	3,8 %	0,5 %	2,7 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	197,0	1,0 %	167,2	0,9 %	-9,8 %	
<b>Sijoitukset yhteensä</b>	<b>19 652,2</b>	<b>100,0 %</b>	<b>18 857,6</b>	<b>96,0 %</b>	<b>2,0 %</b>	<b>3,0 %</b>
<b>Johdannaisten vaikutus</b>			<b>794,6</b>	<b>4,0 %</b>		
<b>Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä</b>	<b>19 652,2</b>	<b>100,0 %</b>	<b>19 652,2</b>	<b>100,0 %</b>		
<b>Jvk-salkun modifioitu duraatio</b>	<b>3,9 vuotta</b>					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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