

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.6.2018 1)

30.6.2018	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
	MEUR	%	MEUR	%		
Korkosijoitukset	8 205,0	42,2 %	7 440,7	38,3 %	-1,5 %	
Lainasaamiset	393,8	2,0 %	393,8	2,0 %	1,5 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 437,3	33,1 %	5 673,1	29,2 %	-2,0 %	2,0 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 355,5	17,3 %	2 591,3	13,3 %	-2,5 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 081,8	15,9 %	3 081,8	15,9 %	-1,6 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 373,8	7,1 %	1 373,8	7,1 %	0,2 %	
Osakesijoitukset	9 415,6	48,5 %	9 281,3	47,8 %	2,1 %	
Noteeratut osakkeet	8 561,3	44,1 %	8 427,0	43,4 %	1,8 %	6,5 %
Pääomasijoitukset	724,8	3,7 %	724,8	3,7 %	7,3 %	
Noteeraamattomat osakkeet	129,5	0,7 %	129,5	0,7 %	3,0 %	
Kiinteistösijoitukset	888,0	4,6 %	888,0	4,6 %	3,4 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	888,0	4,6 %	888,0	4,6 %	3,4 %	
Muut sijoitukset	924,5	4,8 %	1 008,0	5,2 %	-1,1 %	
Hedge-rahastosijoitukset	726,5	3,7 %	726,5	3,7 %	0,2 %	2,7 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	198,0	1,0 %	281,5	1,4 %	-5,7 %	
Sijoitukset yhteensä	19 433,1	100,0 %	18 618,0	95,8 %	0,5 %	3,2 %
Johdannaisten vaikutus			815,0	4,2 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	19 433,1	100,0 %	19 433,1	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	3,7 vuotta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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