

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 31.3.2019 1)

| | Perusjakauma | | Riskijakauma | | MWR-tuotto 2) | Volatiliteetti 3) |
|---|-----------------|----------------|-------------------|----------------|---------------|-------------------|
| | MEUR | % | MEUR | % | | |
| Korkosijoitukset | 8 256,4 | 42,3 % | 7 630,8 | 39,1 % | 2,0 % | |
| Lainasaamiset | 411,7 | 2,1 % | 411,7 | 2,1 % | -0,5 % | |
| Joukkovelkakirjalainat | 6 101,7 | 31,2 % | 5 476,2 | 28,0 % | 2,7 % | 1,9 % |
| Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat | 3 041,2 | 15,6 % | 2 415,7 | 12,4 % | 2,9 % | |
| Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat | 3 060,5 | 15,7 % | 3 060,5 | 15,7 % | 2,5 % | |
| Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset | 1 742,9 | 8,9 % | 1 742,9 | 8,9 % | -0,1 % | |
| Osakesijoitukset | 9 430,6 | 48,3 % | 9 097,3 | 46,6 % | 11,6 % | |
| Noteeratut osakkeet | 8 437,2 | 43,2 % | 8 104,0 | 41,5 % | 12,7 % | 9,9 % |
| Pääomasijoitukset | 804,0 | 4,1 % | 804,0 | 4,1 % | 2,9 % | |
| Noteeraamattomat osakkeet | 189,3 | 1,0 % | 189,3 | 1,0 % | 1,6 % | |
| Kiinteistösijoitukset | 859,4 | 4,4 % | 859,4 | 4,4 % | 4,5 % | |
| Suorat kiinteistösijoitukset | 0,0 | 0,0 % | 0,0 | 0,0 % | 0,0 % | |
| Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset | 859,4 | 4,4 % | 859,4 | 4,4 % | 4,5 % | |
| Muut sijoitukset | 984,8 | 5,0 % | 1 020,5 | 5,2 % | 1,6 % | |
| Hedge-rahastosijoitukset | 754,2 | 3,9 % | 754,2 | 3,9 % | 1,9 % | 3,1 % |
| Hyödykesijoitukset | 0,0 | 0,0 % | 0,0 | 0,0 % | 0,0 % | |
| Muut sijoitukset | 230,6 | 1,2 % | 266,3 | 1,4 % | 0,4 % | |
| Sijoitukset yhteensä | 19 531,1 | 100,0 % | 18 608,0 | 95,3 % | 6,6 % | 4,8 % |
| Johdannaisten vaikutus | | | 923,1 | 4,7 % | | |
| Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä | 19 531,1 | 100,0 % | 19 531,1 | 100,0 % | | |
| Jvk-salkun modifioitu duraatio | | | 3,5 vuotta | | | |

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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