

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.9.2019 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto	Volatiliteetti
	MEUR	%	MEUR	%	2)	3)
					%	%
Korkosijoitukset	8 107,7	40,4 %	7 476,7	37,3 %	4,3 %	
Lainasaamiset	419,2	2,1 %	419,2	2,1 %	1,7 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 224,2	31,1 %	5 593,2	27,9 %	5,6 %	2,2 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 053,5	15,2 %	2 422,5	12,1 %	6,2 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 170,7	15,8 %	3 170,7	15,8 %	5,1 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 464,3	7,3 %	1 464,3	7,3 %	0,2 %	
Osakesijoitukset	10 009,1	49,9 %	9 857,3	49,2 %	16,6 %	
Noteeratut osakkeet	8 896,7	44,4 %	8 745,0	43,6 %	17,7 %	11,4 %
Pääomasijoitukset	923,0	4,6 %	923,0	4,6 %	9,4 %	
Noteeraamattomat osakkeet	189,3	0,9 %	189,3	0,9 %	2,4 %	
Kiinteistösijoitukset	919,5	4,6 %	919,5	4,6 %	8,1 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	919,5	4,6 %	919,5	4,6 %	8,1 %	
Muut sijoitukset	1 008,8	5,0 %	1 027,3	5,1 %	2,8 %	
Hedge-rahastosijoitukset	823,2	4,1 %	823,2	4,1 %	3,3 %	3,1 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	185,6	0,9 %	204,0	1,0 %	0,9 %	
Sijoitukset yhteensä	20 045,1	100,0 %	19 280,8	96,2 %	10,1 %	5,5 %
Johdannaisten vaikutus			764,3	3,8 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	20 045,1	100,0 %	20 045,1	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	3,6 vuotta					
Avoin valuuttapositio on	33,3 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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