

TELA Tuotto-riskitaulukko käyvin arvoin ¹⁾

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto ²⁾	Volatiliteetti ³⁾
	MEUR	%	MEUR	%		
Korkosijoitukset	8 581.8	39.1 %	9 159.2	41.7 %	2.3 %	
Lainasaamiset	735.7	3.3 %	735.7	3.3 %	4.1 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 997.4	31.9 %	7 574.8	34.5 %	2.2 %	4.9 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 686.1	16.8 %	4 045.9	18.4 %	1.5 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 311.4	15.1 %	3 528.9	16.1 %	3.1 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	848.7	3.9 %	848.7	3.9 %	1.5 %	
Osakesijoitukset	11 516.3	52.4 %	11 509.6	52.4 %	4.6 %	
Noteeratut osakkeet	8 854.9	40.3 %	8 848.2	40.3 %	4.6 %	13.1 %
Pääomasijoitukset	2 373.7	10.8 %	2 373.7	10.8 %	4.4 %	
Noteeraamattomat osakkeet	287.7	1.3 %	287.7	1.3 %	5.9 %	
Kiinteistösijoitukset	921.6	4.2 %	921.6	4.2 %	-2.3 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0.0	0.0 %	0.0	0.0 %	0.0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusrytykset	921.6	4.2 %	921.6	4.2 %	-2.3 %	
Muut sijoitukset	944.7	4.3 %	944.7	4.3 %	1.7 %	
Hedge-rahastosijoitukset	944.7	4.3 %	944.7	4.3 %	1.9 %	3.5 %
Hyödykesijoitukset	0.0	0.0 %	0.0	0.0 %	0.0 %	
Muut sijoitukset	0.0	0.0 %	0.0	0.0 %	0.0 %	
Sijoitukset yhteensä	21 964.5	100.0 %	22 535.1	102.6 %	3.2 %	7.0 %
Johdannaisten vaikutus			-570.6	-2.6 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	21 964.5	100.0 %	21 964.5	100.0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	4.8 vuotta					
Avoin valuuttaposition	36.3 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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