

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.6.2016 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		1.1.-30.6.2016	
	MEUR	%	MEUR	%	MWR -tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
					%	%
Korkosijoitukset	8 447,5	47,3 %	8 270,3	46,3 %	3,7 %	
Lainasaamiset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	7 105,6	39,8 %	6 928,4	38,8 %	4,5 %	2,8 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 241,7	12,6 %	2 069,5	11,6 %	3,2 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	4 863,9	27,2 %	4 858,9	27,2 %	5,1 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 341,9	7,5 %	1 341,9	7,5 %	0,0 %	
Osakesijoitukset	8 213,8	46,0 %	8 179,2	45,8 %	-1,7 %	
Noteeratut osakkeet	7 350,0	41,2 %	7 315,4	41,0 %	-2,4 %	13,8 %
Pääomasijoitukset	768,5	4,3 %	768,5	4,3 %	4,6 %	
Noteeraamattomat osakkeet	95,3	0,5 %	95,3	0,5 %	4,8 %	
Kiinteistösijoitukset	506,7	2,8 %	506,7	2,8 %	1,8 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	506,7	2,8 %	506,7	2,8 %	1,8 %	
Muut sijoitukset	690,6	3,9 %	707,2	4,0 %	-1,6 %	
Hedge-rahastosijoitukset	598,0	3,3 %	598,0	3,3 %	-2,3 %	3,3 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	92,6	0,5 %	109,2	0,6 %	5,6 %	
Sijoitukset yhteensä	17 858,7	100,0 %	17 663,4	98,9 %	0,9 %	7,1 %
Johdannaisten vaikutus			195,3	1,1 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	17 858,7	100,0 %	17 858,7	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio			4,2 vuotta			

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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