

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 31.3.2018 1)

31.3.2018	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
	MEUR	%	MEUR	%		
Korkosijoitukset	8 146,8	42,3 %	7 561,7	39,2 %	-0,3 %	
Lainasaamiset	347,3	1,8 %	347,3	1,8 %	0,7 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 529,3	33,9 %	5 944,2	30,8 %	-0,4 %	2,0 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 338,5	17,3 %	2 769,6	14,4 %	-0,4 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 190,8	16,6 %	3 174,6	16,5 %	-0,3 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 270,2	6,6 %	1 270,2	6,6 %	0,0 %	
Osakesijoitukset	9 324,4	48,4 %	9 309,5	48,3 %	-1,8 %	
Noteeratut osakkeet	8 519,8	44,2 %	8 504,9	44,1 %	-2,1 %	6,3 %
Pääomasijoitukset	647,2	3,4 %	647,2	3,4 %	2,3 %	
Noteeraamattomat osakkeet	157,4	0,8 %	157,4	0,8 %	3,0 %	
Kiinteistösijoitukset	877,0	4,6 %	877,0	4,6 %	-0,8 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	877,0	4,6 %	877,0	4,6 %	-0,8 %	
Muut sijoitukset	921,1	4,8 %	1 005,4	5,2 %	0,7 %	
Hedge-rahastosijoitukset	719,5	3,7 %	719,5	3,7 %	1,6 %	2,5 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	201,6	1,0 %	285,9	1,5 %	-2,6 %	
Sijoitukset yhteensä	19 269,4	100,0 %	18 753,6	97,3 %	-1,0 %	3,0 %
Johdannaisten vaikutus			515,8	2,7 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	19 269,4	100,0 %	19 269,4	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	3,7 vuotta					
Avoin valuuttaposition	25,7 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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