

TELA Tuotto-riskitaulukko käyvin arvoin ¹⁾

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto ²⁾	Volatiliteetti ³⁾
	MEUR	%	MEUR	%	%	%
Korkosijoitukset	8 559.5	38.7 %	8 863.1	40.1 %	2.6 %	
Lainasaamiset	717.6	3.2 %	717.6	3.2 %	1.9 %	
Joukkovelkakirjalainat	7 098.1	32.1 %	7 401.7	33.4 %	2.9 %	4.9 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 801.7	17.2 %	3 888.9	17.6 %	2.8 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 296.4	14.9 %	3 512.9	15.9 %	3.1 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	743.8	3.4 %	743.8	3.4 %	0.8 %	
Osakesijoitukset	11 721.1	53.0 %	11 626.3	52.5 %	5.4 %	
Noteeratut osakkeet	9 154.4	41.4 %	9 059.6	40.9 %	6.2 %	13.2 %
Pääomasijoitukset	2 282.3	10.3 %	2 282.3	10.3 %	2.5 %	
Noteeraamattomat osakkeet	284.4	1.3 %	284.4	1.3 %	4.7 %	
Kiinteistösijoitukset	934.2	4.2 %	934.2	4.2 %	-1.1 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0.0	0.0 %	0.0	0.0 %	0.0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	934.2	4.2 %	934.2	4.2 %	-1.1 %	
Muut sijoitukset	913.1	4.1 %	913.1	4.1 %	-1.0 %	
Hedge-rahastosijoitukset	913.2	4.1 %	913.2	4.1 %	-0.6 %	3.5 %
Hyödykesijoitukset	0.0	0.0 %	0.0	0.0 %	0.0 %	
Muut sijoitukset	-0.1	0.0 %	-0.1	0.0 %		
Sijoitukset yhteensä	22 127.9	100.0 %	22 336.8	100.9 %	3.7 %	7.0 %
Johdannaisten vaikutus			-208.9	-0.9 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	22 127.9	100.0 %	22 127.9	100.0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	4.4 vuotta					
Avoin valuuttapositio on	36.4 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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