

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltyinä 31.3.2023 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
	MEUR	%	MEUR	%		
Korkosijoitukset	8 648,1	39,4 %	8 826,6	40,2 %	1,5 %	
Lainasaamiset	720,0	3,3 %	720,0	3,3 %	-0,3 %	
Joukkovelkakirjalainat	7 122,4	32,5 %	7 300,9	33,3 %	1,9 %	4,9 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 959,2	18,0 %	3 918,3	17,9 %	1,8 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 163,3	14,4 %	3 382,6	15,4 %	2,0 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	805,7	3,7 %	805,7	3,7 %	0,4 %	
Osakesijoitukset	11 420,5	52,1 %	11 358,8	51,8 %	3,3 %	
Noteeratut osakkeet	8 927,5	40,7 %	8 865,9	40,4 %	4,1 %	13,3 %
Pääomasijoitukset	2 206,4	10,1 %	2 206,4	10,1 %	0,1 %	
Noteeraamattomat osakkeet	286,6	1,3 %	286,6	1,3 %	4,1 %	
Kiinteistösijoitukset	929,2	4,2 %	929,2	4,2 %	-1,8 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusryitykset	929,2	4,2 %	929,2	4,2 %	-1,8 %	
Muut sijoitukset	937,8	4,3 %	937,8	4,3 %	-0,4 %	
Hedge-rahastosijoitukset	937,5	4,3 %	937,5	4,3 %	-0,4 %	3,5 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	0,4	0,0 %	0,4	0,0 %	-13,2 %	
Sijoitukset yhteensä	21 935,6	100,0 %	22 052,5	100,5 %	2,2 %	7,2 %
Johdannaisten vaikutus			-116,9	-0,5 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	21 935,6	100,0 %	21 935,6	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio			4,2 vuotta			
Avoin valuuttapositio on			36,1 % sijoitusten arvosta			

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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