

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltyinä 31.3.2021 ¹⁾

	Perusjakauma MEUR	Riskijakauma % MEUR		MWR-tuotto ²⁾ %	Volatiliteetti ³⁾ %
Korkosijoitukset	7 865,9	35,9 %	7 783,2	35,5 %	-0,3 %
Lainasaamiset	508,8	2,3 %	508,8	2,3 %	1,8 %
Joukkovelkakirjalainat	6 116,7	27,9 %	6 034,0	27,5 %	-0,5 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 095,7	14,1 %	2 989,6	13,6 %	-0,4 %
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 021,0	13,8 %	3 044,5	13,9 %	-0,7 %
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 240,4	5,7 %	1 240,4	5,7 %	0,2 %
Osakesijoitukset	12 369,3	56,4 %	11 934,7	54,4 %	9,6 %
Noteeratut osakkeet	10 780,2	49,1 %	10 345,6	47,2 %	9,4 %
Pääomasijoitukset	1 343,9	6,1 %	1 343,9	6,1 %	6,9 %
Noteeraamattomat osakkeet	245,1	1,1 %	245,1	1,1 %	37,8 %
Kiinteistösijoitukset	746,7	3,4 %	746,7	3,4 %	0,4 %
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusryitykset	746,7	3,4 %	746,7	3,4 %	0,4 %
Muut sijoitukset	953,7	4,3 %	953,7	4,3 %	1,9 %
Hedge-rahastosijoitukset	952,0	4,3 %	952,0	4,3 %	2,0 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %
Muut sijoitukset	1,7	0,0 %	1,7	0,0 %	7,4 %
Sijoitukset yhteensä	21 935,5	100,0 %	21 418,2	97,6 %	5,2 %
Johdannaisten vaikutus			517,3	2,4 %	10,4 %
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	21 935,5	100,0 %	21 935,5	100,0 %	
Jvk-salkun modifioitu duraatio	5,6 vuotta				
Avoin valuuttapositio on	39,1 % sijoitusten arvosta				
Korkosijoitusten modifioitu duraatio	5,3 vuotta				

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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