

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltyinä 31.12.2019 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto	Volatiliteetti
	MEUR	%	MEUR	%	2) %	3) %
Korkosijoitukset	7 952,9	38,6 %	7 680,0	37,3 %	4,9 %	
Lainasaamiset	423,3	2,1 %	423,3	2,1 %	3,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 325,6	30,7 %	6 052,6	29,4 %	6,3 %	2,2 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 161,5	15,4 %	2 888,6	14,0 %	7,1 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 164,1	15,4 %	3 164,1	15,4 %	5,6 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 204,1	5,8 %	1 204,1	5,8 %	-0,1 %	
Osakesijoitukset	10 513,2	51,1 %	10 492,5	51,0 %	23,2 %	
Noteeratut osakkeet	9 344,2	45,4 %	9 323,5	45,3 %	24,6 %	11,4 %
Pääomasijoitukset	968,9	4,7 %	968,9	4,7 %	13,6 %	
Noteeraamattomat osakkeet	200,1	1,0 %	200,1	1,0 %	8,2 %	
Kiinteistösijoitukset	1 062,1	5,2 %	1 062,1	5,2 %	14,8 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	1 062,1	5,2 %	1 062,1	5,2 %	14,8 %	
Muut sijoitukset	1 059,9	5,1 %	1 077,8	5,2 %	3,8 %	
Hedge-rahastosijoitukset	855,7	4,2 %	855,7	4,2 %	4,9 %	3,1 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	204,2	1,0 %	222,1	1,1 %	-0,5 %	
Sijoitukset yhteensä	20 588,1	100,0 %	20 312,3	98,7 %	13,8 %	5,5 %
Johdannaisten vaikutus			275,8	1,3 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	20 588,1	100,0 %	20 588,1	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	4,5 vuotta					
Avoin valuuttapositio on	37,0 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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