

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltyinä 31.12.2020 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR- Volatiliteetti	
	MEUR	%	MEUR	%	tuotto 2)	3)
					%	%
Korkosijoitukset	7 843,1	37,4 %	7 598,5	36,3 %	2,3 %	
Lainasaamiset	494,3	2,4 %	494,3	2,4 %	4,4 %	
Joukkovelkakirjalainat	5 930,0	28,3 %	5 685,4	27,1 %	2,4 %	6,1 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 966,7	14,2 %	2 722,1	13,0 %	1,1 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 963,3	14,1 %	2 963,3	14,1 %	3,8 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 418,8	6,8 %	1 418,8	6,8 %	0,7 %	
Osakesijoitukset	11 199,2	53,4 %	11 188,7	53,4 %	6,6 %	
Noteeratut osakkeet	9 763,7	46,6 %	9 753,2	46,5 %	6,2 %	19,0 %
Pääomasijoitukset	1 210,1	5,8 %	1 210,1	5,8 %	8,7 %	
Noteeraamattomat osakkeet	225,4	1,1 %	225,4	1,1 %	12,2 %	
Kiinteistösijoitukset	1 037,0	4,9 %	1 037,0	4,9 %	-5,5 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	1 037,0	4,9 %	1 037,0	4,9 %	-5,5 %	
Muut sijoitukset	884,3	4,2 %	1 048,5	5,0 %	1,1 %	
Hedge-rahastosijoitukset	784,2	3,7 %	784,2	3,7 %	4,9 %	7,4 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	100,0	0,5 %	264,3	1,3 %	-18,0 %	
Sijoitukset yhteensä	20 963,6	100,0 %	20 872,7	99,6 %	4,0 %	10,5 %
Johdannaisten vaikutus			90,9	0,4 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	20 963,6	100,0 %	20 963,6	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio			5,4 vuotta			
Avoin valuuttapositio on			41,1 % sijoitusten arvosta			

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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