

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltyinä 30.9.2021 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
	MEUR	%	MEUR	%	%	%
Korkosijoitukset	8 563,1	37,4 %	8 316,6	36,3 %	1,4 %	
Lainasaamiset	572,9	2,5 %	572,9	2,5 %	8,6 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 654,1	29,1 %	6 407,6	28,0 %	1,0 %	6,0 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 386,9	14,8 %	3 117,2	13,6 %	1,7 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 267,2	14,3 %	3 290,4	14,4 %	0,4 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 336,1	5,8 %	1 336,1	5,8 %	0,5 %	
Osakesijoitukset	12 378,0	54,1 %	11 550,0	50,5 %	18,3 %	
Noteeratut osakkeet	10 474,9	45,8 %	9 646,9	42,2 %	16,7 %	18,0 %
Pääomasijoitukset	1 647,1	7,2 %	1 647,1	7,2 %	25,2 %	
Noteeraamattomat osakkeet	256,0	1,1 %	256,0	1,1 %	55,1 %	
Kiinteistösijoitukset	744,0	3,3 %	744,0	3,3 %	6,1 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	744,0	3,3 %	744,0	3,3 %	6,1 %	
Muut sijoitukset	1 199,2	5,2 %	1 199,2	5,2 %	4,0 %	
Hedge-rahastosijoitukset	1 199,0	5,2 %	1 199,0	5,2 %	4,5 %	7,4 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	0,2	0,0 %	0,2	0,0 %		
Sijoitukset yhteensä	22 884,2	100,0 %	21 809,8	95,3 %	10,6 %	10,2 %
Johdannaisten vaikutus			1 074,4	4,7 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	22 884,2	100,0 %	22 884,2	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	5,1 vuotta					
Avoin valuuttapositio on	41,5 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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