

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.6.2015

	Perusjakauma		Riskijakauma		1-6/2015	Volatiliteetti
	MEUR 1)	%	MEUR 1)	%	MWR-tuotto 2)	3)
					%	%
Korkosijoitukset	9 059,6	49,7 %	9 031,6	49,5 %	0,5 %	
Lainasaamiset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	7 403,7	40,6 %	7 375,8	40,4 %	0,6 %	2,5 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 969,5	16,3 %	2 941,5	16,1 %	2,3 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	4 434,2	24,3 %	4 434,2	24,3 %	-0,5 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 655,8	9,1 %	1 655,8	9,1 %	0,2 %	
Osakesijoitukset	8 141,3	44,6 %	8 107,4	44,5 %	12,2 %	
Noteeratut osakkeet	7 236,8	39,7 %	7 203,0	39,5 %	13,3 %	9,0 %
Pääomasijoitukset	667,0	3,7 %	667,0	3,7 %	2,7 %	
Noteeraamattomat osakkeet	237,5	1,3 %	237,5	1,3 %	6,1 %	
Kiinteistösijoitukset	483,4	2,7 %	483,4	2,7 %	2,1 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	483,4	2,7 %	483,4	2,7 %	2,1 %	
Muut sijoitukset	553,4	3,0 %	553,4	3,0 %	3,0 %	
Hedge-rahastosijoitukset	553,5	3,0 %	553,5	3,0 %	3,6 %	2,7 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	-0,1	0,0 %	-0,1	0,0 %		
Sijoitukset yhteensä	18 237,6	100,0 %	18 175,8	99,7 %	5,5 %	4,3 %
Johdannaisten vaikutus			61,9	0,3 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	18 237,6	100,0 %	18 237,6	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	4,4 vuotta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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