

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 31.3.2015

	Perusjakauma		Riskijakauma		1-3/2015	
	MEUR 1)	%	MEUR 1)	%	MWR-tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
					%	%
Korkosijoitukset	9 328,9	49,8 %	9 383,0	50,0 %	1,8 %	
Lainasaamiset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	7 341,9	39,2 %	7 396,0	39,5 %	2,2 %	3,2 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 953,3	15,8 %	3 007,4	16,0 %	4,4 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	4 388,6	23,4 %	4 388,6	23,4 %	0,5 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 987,0	10,6 %	1 987,0	10,6 %	0,2 %	
Osakesijoitukset	8 392,0	44,8 %	8 383,1	44,7 %	15,0 %	
Noteeratut osakkeet	7 558,0	40,3 %	7 549,1	40,3 %	16,7 %	9,1 %
Pääomasijoitukset	622,7	3,3 %	622,7	3,3 %	0,2 %	
Noteeraamattomat osakkeet	211,2	1,1 %	211,2	1,1 %	0,9 %	
Kiinteistösijoitukset	464,4	2,5 %	464,4	2,5 %	1,5 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	464,4	2,5 %	464,4	2,5 %	1,5 %	
Muut sijoitukset	562,0	3,0 %	562,0	3,0 %	0,9 %	
Hedge-rahastosijoitukset	564,6	3,0 %	564,6	3,0 %	3,3 %	2,9 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	-2,6	0,0 %	-2,6	0,0 %		
Sijoitukset yhteensä	18 747,3	100,0 %	18 792,5	100,2 %	7,4 %	4,6 %
Johdannaisten vaikutus			-45,2	-0,2 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	18 747,3	100,0 %	18 747,3	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio			4,3 vuotta			

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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