

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 31.12.2018 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto	Volatiliteetti
	MEUR	%	MEUR	%	2) %	3) %
Korkosijoitukset	7 832,4	42,4 %	7 106,2	38,4 %	-1,4 %	
Lainasaamiset	409,1	2,2 %	409,1	2,2 %	8,4 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 227,7	33,7 %	5 501,6	29,8 %	-2,4 %	1,7 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 094,7	16,7 %	2 368,6	12,8 %	-2,3 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 133,0	16,9 %	3 133,0	16,9 %	-2,5 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 195,6	6,5 %	1 195,6	6,5 %	0,7 %	
Osakesijoitukset	8 856,9	47,9 %	8 776,8	47,5 %	-5,8 %	
Noteeratut osakkeet	7 915,3	42,8 %	7 835,2	42,4 %	-7,4 %	8,7 %
Pääomasijoitukset	755,3	4,1 %	755,3	4,1 %	12,5 %	
Noteeraamattomat osakkeet	186,3	1,0 %	186,3	1,0 %	7,3 %	
Kiinteistösijoitukset	825,6	4,5 %	825,6	4,5 %	5,1 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösisjoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	825,6	4,5 %	825,6	4,5 %	5,1 %	
Muut sijoitukset	970,8	5,3 %	940,3	5,1 %	-4,3 %	
Hedge-rahastosijoitukset	777,3	4,2 %	777,3	4,2 %	-2,5 %	3,1 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	193,4	1,0 %	163,0	0,9 %	-10,3 %	
Sijoitukset yhteensä	18 485,7	100,0 %	17 649,0	95,5 %	-3,4 %	4,1 %
Johdannaisten vaikutus			836,6	4,5 %		
Sijoitukset käyvin arvo in yhteensä	18 485,7	100,0 %	18 485,7	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	3,5 vuotta					
Avoin valuuttapositio on	27,3 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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