

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.6.2019 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
	MEUR	%	MEUR	%		
Korkosijoitukset	8 211,5	41,8 %	7 609,6	38,7 %	3,4 %	
Lainasaamiset	409,8	2,1 %	409,8	2,1 %	0,6 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 208,5	31,6 %	5 606,6	28,5 %	4,6 %	2,1 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 124,2	15,9 %	2 522,3	12,8 %	4,7 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 084,3	15,7 %	3 084,3	15,7 %	4,4 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 593,2	8,1 %	1 593,2	8,1 %	0,0 %	
Osakesijoitukset	9 621,7	48,9 %	9 436,7	48,0 %	13,5 %	
Noteeratut osakkeet	8 580,3	43,6 %	8 395,3	42,7 %	14,5 %	11,1 %
Pääomasijoitukset	852,0	4,3 %	852,0	4,3 %	5,9 %	
Noteeraamattomat osakkeet	189,3	1,0 %	189,3	1,0 %	2,4 %	
Kiinteistösijoitukset	859,2	4,4 %	859,2	4,4 %	5,2 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	859,2	4,4 %	859,2	4,4 %	5,2 %	
Muut sijoitukset	965,7	4,9 %	983,4	5,0 %	3,1 %	
Hedge-rahastosijoitukset	783,6	4,0 %	783,6	4,0 %	4,1 %	3,2 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	182,1	0,9 %	199,8	1,0 %	-0,6 %	
Sijoitukset yhteensä	19 658,2	100,0 %	18 888,9	96,1 %	8,2 %	5,4 %
Johdannaisten vaikutus			769,3	3,9 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	19 658,2	100,0 %	19 658,2	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	3,7 vuotta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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