

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.9.2017 1)

30.9.2017	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR -tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
	MEUR	%	MEUR	%		
Korkosijoitukset	8 532,9	43,9 %	8 047,9	41,4 %	1,9 %	
Lainasaamiset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 453,8	33,2 %	5 968,8	30,7 %	2,6 %	2,5 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 180,7	16,4 %	2 709,2	13,9 %	3,0 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 273,1	16,8 %	3 259,6	16,8 %	2,2 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	2 079,1	10,7 %	2 079,1	10,7 %	-0,2 %	
Osakesijoitukset	9 247,3	47,6 %	9 292,0	47,8 %	9,1 %	
Noteeratut osakkeet	8 266,6	42,5 %	8 311,3	42,7 %	9,2 %	9,9 %
Pääomasijoitukset	825,3	4,2 %	825,3	4,2 %	9,0 %	
Noteeraamattomat osakkeet	155,3	0,8 %	155,3	0,8 %	8,3 %	
Kiinteistösijoitukset	749,3	3,9 %	749,3	3,9 %	2,2 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	749,3	3,9 %	749,3	3,9 %	2,2 %	
Muut sijoitukset	917,3	4,7 %	1 012,6	5,2 %	2,5 %	
Hedge-rahastosijoitukset	728,4	3,7 %	728,4	3,7 %	3,5 %	2,1 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	188,8	1,0 %	284,1	1,5 %	-1,4 %	
Sijoitukset yhteensä	19 446,7	100,0 %	19 101,7	98,2 %	5,2 %	4,5 %
Johdannaisten vaikutus			345,0	1,8 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	19 446,7	100,0 %	19 446,7	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio			3,7 vuotta			
Avoin valuuttapositio on			21,9 % sijoitusten arvosta			

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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