

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 31.3.2020 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto	Volatiliteetti
	MEUR	%	MEUR	%	2) %	3) %
Korkosijoitukset	7 237,2	40,5 %	6 961,3	39,0 %	-5,3 %	
Lainasaamiset	437,0	2,4 %	437,0	2,4 %	1,1 %	
Joukkovelkakirjalainat	5 766,2	32,3 %	5 490,3	30,7 %	-6,5 %	5,7 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 971,1	16,6 %	2 695,2	15,1 %	-5,3 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 795,0	15,6 %	2 795,0	15,6 %	-7,8 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 034,0	5,8 %	1 034,0	5,8 %	-0,1 %	
Osakesijoitukset	8 835,2	49,5 %	8 985,3	50,3 %	-18,8 %	
Noteeratut osakkeet	7 614,6	42,6 %	7 764,6	43,5 %	-21,6 %	17,3 %
Pääomasijoitukset	999,6	5,6 %	999,6	5,6 %	2,2 %	
Noteeraamattomat osakkeet	221,0	1,2 %	221,0	1,2 %	10,4 %	
Kiinteistösijoitukset	929,5	5,2 %	929,5	5,2 %	-7,5 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	929,5	5,2 %	929,5	5,2 %	-7,5 %	
Muut sijoitukset	861,8	4,8 %	880,2	4,9 %	-9,6 %	
Hedge-rahastosijoitukset	715,4	4,0 %	715,4	4,0 %	-8,3 %	6,4 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	146,5	0,8 %	164,8	0,9 %	-14,8 %	
Sijoitukset yhteensä	17 863,8	100,0 %	17 756,2	99,4 %	-12,6 %	9,5 %
Johdannaisten vaikutus			107,5	0,6 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	17 863,8	100,0 %	17 863,8	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	4,9 vuotta					
Avoin valuuttapositio on	38,5 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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