

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 31.3.2016 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		1.1.-31.3.2016	
	MEUR	%	MEUR	%	MWR -tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
					%	%
Korkosijoitukset	8 421,8	47,8 %	8 218,8	46,6 %	1,9 %	
Lainasaamiset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 911,6	39,2 %	6 708,6	38,0 %	2,3 %	2,8 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 275,3	12,9 %	2 072,3	11,8 %	1,2 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	4 636,3	26,3 %	4 636,3	26,3 %	2,9 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 510,2	8,6 %	1 510,2	8,6 %	0,0 %	
Osakesijoitukset	8 044,6	45,6 %	8 023,2	45,5 %	-3,5 %	
Noteeratut osakkeet	7 204,3	40,8 %	7 182,9	40,7 %	-4,2 %	13,8 %
Pääomasijoitukset	750,8	4,3 %	750,8	4,3 %	1,9 %	
Noteeraamattomat osakkeet	89,5	0,5 %	89,5	0,5 %	3,8 %	
Kiinteistösijoitukset	501,2	2,8 %	501,2	2,8 %	-0,1 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	501,2	2,8 %	501,2	2,8 %	-0,1 %	
Muut sijoitukset	668,7	3,8 %	668,7	3,8 %	-1,8 %	
Hedge-rahastosijoitukset	626,5	3,6 %	626,5	3,6 %	-2,3 %	3,3 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	42,3	0,2 %	42,3	0,2 %	5,7 %	
Sijoitukset yhteensä	17 636,3	100,0 %	17 412,0	98,7 %	-0,8 %	7,8 %
Johdannaisten vaikutus			224,4	1,3 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	17 636,3	100,0 %	17 636,3	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio			4,0 vuotta			

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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