

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.6.2020 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto	Volatiliteetti
	MEUR	%	MEUR	%	2) %	3) %
Korkosijoitukset	7 519,6	39,0 %	7 290,1	37,8 %	-1,2 %	
Lainasaamiset	442,5	2,3 %	442,5	2,3 %	-1,5 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 007,3	31,1 %	5 777,8	29,9 %	-1,4 %	6,1 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 008,1	15,6 %	2 753,8	14,3 %	-1,0 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 999,2	15,5 %	3 024,0	15,7 %	-1,8 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 069,8	5,5 %	1 069,8	5,5 %	0,4 %	
Osakesijoitukset	10 037,0	52,0 %	10 223,3	53,0 %	-7,7 %	
Noteeratut osakkeet	8 841,7	45,8 %	9 027,9	46,8 %	-8,5 %	18,6 %
Pääomasijoitukset	973,1	5,0 %	973,1	5,0 %	-3,4 %	
Noteeraamattomat osakkeet	222,3	1,2 %	222,3	1,2 %	11,0 %	
Kiinteistösijoitukset	929,4	4,8 %	929,4	4,8 %	-7,0 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	929,4	4,8 %	929,4	4,8 %	-7,0 %	
Muut sijoitukset	805,5	4,2 %	823,4	4,3 %	-5,0 %	
Hedge-rahastosijoitukset	701,2	3,6 %	701,2	3,6 %	-2,3 %	7,1 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	104,3	0,5 %	122,1	0,6 %	-17,0 %	
Sijoitukset yhteensä	19 291,5	100,0 %	19 266,1	99,9 %	-5,1 %	10,2 %
Johdannaisten vaikutus			25,4	0,1 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	19 291,5	100,0 %	19 291,5	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	5,3 vuotta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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