

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 31.12.2015 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		1.1.-31.12.2015	
	MEUR	%	MEUR	%	MWR-tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
					%	%
Korkosijoitukset	8 597,7	48,2 %	8 526,8	47,8 %	0,2 %	
Lainasaamiset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	7 191,8	40,3 %	7 120,9	39,9 %	0,2 %	2,7 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 644,9	14,8 %	2 574,0	14,4 %	4,4 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	4 546,8	25,5 %	4 546,8	25,5 %	-2,5 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 406,0	7,9 %	1 406,0	7,9 %	0,5 %	
Osakesijoitukset	8 164,5	45,7 %	8 163,8	45,7 %	10,6 %	
Noteeratut osakkeet	7 315,2	41,0 %	7 314,6	41,0 %	10,3 %	13,2 %
Pääomasijoitukset	753,0	4,2 %	753,0	4,2 %	13,5 %	
Noteeraamattomat osakkeet	96,2	0,5 %	96,2	0,5 %	9,1 %	
Kiinteistösijoitukset	503,3	2,8 %	503,3	2,8 %	9,5 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	503,3	2,8 %	503,3	2,8 %	9,5 %	
Muut sijoitukset	587,9	3,3 %	587,9	3,3 %	3,1 %	
Hedge-rahastosijoitukset	556,8	3,1 %	556,8	3,1 %	2,5 %	3,2 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	31,0	0,2 %	31,0	0,2 %	33,7 %	
Sijoitukset yhteensä	17 853,3	100,0 %	17 781,8	99,6 %	4,9 %	6,0 %
Johdannaisten vaikutus			71,5	0,4 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	17 853,3	100,0 %	17 853,3	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	4,4 vuotta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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