

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.6.2017 1)

30.6.2017	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
	MEUR	%	MEUR	%		
Korkosijoitukset	8 642,3	44,9 %	8 181,1	42,5 %	1,2 %	
Lainasaamiset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 482,7	33,7 %	6 021,5	31,3 %	1,7 %	2,7 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 180,9	16,5 %	2 728,4	14,2 %	2,0 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 301,9	17,2 %	3 293,1	17,1 %	1,4 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	2 159,6	11,2 %	2 159,6	11,2 %	-0,2 %	
Osakesijoitukset	8 935,6	46,4 %	8 747,8	45,5 %	6,8 %	
Noteeratut osakkeet	7 985,0	41,5 %	7 797,1	40,5 %	6,9 %	12,5 %
Pääomasijoitukset	796,2	4,1 %	796,2	4,1 %	6,1 %	
Noteeraamattomat osakkeet	154,5	0,8 %	154,5	0,8 %	7,4 %	
Kiinteistösjoitukset	750,3	3,9 %	750,3	3,9 %	0,4 %	
Suorat kiinteistösjoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösjoitusrahasotot ja yhteissijoitusyritykset	750,3	3,9 %	750,3	3,9 %	0,4 %	
Muut sijoitukset	912,4	4,7 %	1 006,3	5,2 %	1,0 %	
Hedge-rahastosijoitukset	723,7	3,8 %	723,7	3,8 %	1,7 %	2,5 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	188,6	1,0 %	282,6	1,5 %	-2,1 %	
Sijoitukset yhteensä	19 240,6	100,0 %	18 685,5	97,1 %	3,7 %	5,6 %
Johdannaisten vaikutus			555,1	2,9 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	19 240,6	100,0 %	19 240,6	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio			3,9 vuotta			
Avoin valuuttapositio on			21 % sijoitusten arvosta			

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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