

TELA Tuotto-riskitaulukko käyvin arvoin ¹⁾

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto ²⁾	Volatiliteetti ³⁾
	MEUR	%	MEUR	%		
Korkosijoitukset	8 747.1	38.4 %	9 179.9	40.3 %	7.0 %	
Lainasaamiset	747.8	3.3 %	747.8	3.3 %	7.9 %	
Joukkovelkakirjalainat	7 114.7	31.2 %	7 547.6	33.1 %	7.5 %	5.7 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 711.0	16.3 %	3 932.0	17.2 %	6.6 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 403.8	14.9 %	3 615.6	15.9 %	8.6 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	884.6	3.9 %	884.6	3.9 %	2.0 %	
Osakesijoitukset	12 232.3	53.6 %	12 149.9	53.3 %	10.0 %	
Noteeratut osakkeet	9 549.0	41.9 %	9 466.6	41.5 %	11.3 %	13.9 %
Pääomasijoitukset	2 399.3	10.5 %	2 399.3	10.5 %	5.7 %	
Noteeraamattomat osakkeet	284.0	1.2 %	284.0	1.2 %	6.0 %	
Kiinteistösijoitukset	888.5	3.9 %	888.5	3.9 %	-6.8 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0.0	0.0 %	0.0	0.0 %	0.0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	888.5	3.9 %	888.5	3.9 %	-6.8 %	
Muut sijoitukset	935.1	4.1 %	935.1	4.1 %	2.7 %	
Hedge-rahastosijoitukset	936.2	4.1 %	936.2	4.1 %	3.2 %	3.4 %
Hyödykesijoitukset	0.0	0.0 %	0.0	0.0 %	0.0 %	
Muut sijoitukset	-1.1	0.0 %	-1.1	0.0 %		
Sijoitukset yhteensä	22 802.9	100.0 %	23 153.4	101.5 %	7.7 %	7.4 %
Johdannaisten vaikutus			-350.5	-1.5 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	22 802.9	100.0 %	22 802.9	100.0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	4.7 vuotta					
Avoin valuuttapositio on	36.9 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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