

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.9.2016 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		1.1.-30.9.2016	
	MEUR	%	MEUR	%	MWR -tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
					%	%
Korkosijoitukset	8 941,2	48,4 %	8 662,5	46,9 %	4,9 %	
Lainasaamiset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 631,3	35,9 %	6 352,6	34,4 %	6,1 %	2,7 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 069,7	11,2 %	1 799,9	9,8 %	3,8 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	4 561,6	24,7 %	4 552,7	24,7 %	7,2 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	2 309,9	12,5 %	2 309,9	12,5 %	0,0 %	
Osakesijoitukset	8 349,8	45,2 %	8 240,2	44,6 %	4,3 %	
Noteeratut osakkeet	7 496,0	40,6 %	7 386,4	40,0 %	4,1 %	14,0 %
Pääomasijoitukset	756,0	4,1 %	756,0	4,1 %	5,9 %	
Noteeraamattomat osakkeet	97,8	0,5 %	97,8	0,5 %	7,6 %	
Kiinteistösijoitukset	509,7	2,8 %	509,7	2,8 %	4,3 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	509,7	2,8 %	509,7	2,8 %	4,3 %	
Muut sijoitukset	656,9	3,6 %	673,4	3,6 %	-0,2 %	
Hedge-rahastosijoitukset	559,1	3,0 %	559,1	3,0 %	-0,9 %	3,1 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	97,8	0,5 %	114,3	0,6 %	6,0 %	
Sijoitukset yhteensä	18 457,6	100,0 %	18 085,8	98,0 %	4,4 %	6,7 %
Johdannaisten vaikutus			371,8	2,0 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	18 457,6	100,0 %	18 457,6	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio			4,3 vuotta			

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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