

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 30.9.2020 1)

	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto 2) %	Volatiliteetti 3) %
	MEUR	%	MEUR	%		
Korkosijoitukset	7 621,4	38,6 %	7 372,3	37,3 %	-0,2 %	
Lainasaamiset	460,1	2,3 %	460,1	2,3 %	0,5 %	
Joukkovelkakirjalainat	5 840,3	29,6 %	5 591,1	28,3 %	-0,4 %	6,0 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 998,3	15,2 %	2 749,2	13,9 %	-1,3 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	2 842,0	14,4 %	2 842,0	14,4 %	0,5 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 321,1	6,7 %	1 321,1	6,7 %	0,5 %	
Osakesijoitukset	10 391,0	52,6 %	10 391,0	52,6 %	-3,4 %	
Noteeratut osakkeet	9 124,6	46,2 %	9 124,6	46,2 %	-4,1 %	18,8 %
Pääomasijoitukset	1 042,6	5,3 %	1 042,6	5,3 %	0,8 %	
Noteeraamattomat osakkeet	223,9	1,1 %	223,9	1,1 %	11,8 %	
Kiinteistösijoitukset	914,1	4,6 %	914,1	4,6 %	-8,9 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	914,1	4,6 %	914,1	4,6 %	-8,9 %	
Muut sijoitukset	827,8	4,2 %	991,5	5,0 %	-3,4 %	
Hedge-rahastosijoitukset	766,9	3,9 %	766,9	3,9 %	-0,5 %	7,2 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	60,9	0,3 %	224,6	1,1 %	-22,8 %	
Sijoitukset yhteensä	19 754,3	100,0 %	19 669,0	99,6 %	-2,5 %	10,3 %
Johdannaisten vaikutus			85,4	0,4 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	19 754,3	100,0 %	19 754,3	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	5,4 vuotta					
Avoin valuuttapositio on	39,1 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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