

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 31.3.2017 1)

31.3.2017	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR-tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
	MEUR	%	MEUR	%		
Korkosijoitukset	8 852,7	46,1 %	8 510,1	44,3 %	1,0 %	
Lainasaamiset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 520,2	33,9 %	6 177,6	32,1 %	1,3 %	2,9 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	1 825,7	9,5 %	1 492,5	7,8 %	-0,3 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	4 694,4	24,4 %	4 685,1	24,4 %	2,0 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	2 332,5	12,1 %	2 332,5	12,1 %	-0,1 %	
Osakesijoitukset	8 920,8	46,4 %	8 896,1	46,3 %	5,3 %	
Noteeratut osakkeet	8 021,9	41,7 %	7 997,2	41,6 %	5,7 %	12,9 %
Pääomasijoitukset	749,5	3,9 %	749,5	3,9 %	2,2 %	
Noteeraamattomat osakkeet	149,4	0,8 %	149,4	0,8 %	3,8 %	
Kiinteistösisijoitukset	636,9	3,3 %	636,9	3,3 %	-0,2 %	
Suorat kiinteistösisijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösisijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	636,9	3,3 %	636,9	3,3 %	-0,2 %	
Muut sijoitukset	812,8	4,2 %	807,6	4,2 %	1,6 %	
Hedge-rahastosijoitukset	669,1	3,5 %	669,1	3,5 %	1,6 %	2,7 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	143,7	0,7 %	138,5	0,7 %	1,6 %	
Sijoitukset yhteensä	19 223,2	100,0 %	18 850,7	98,1 %	3,0 %	5,8 %
Johdannaisten vaikutus			372,5	1,9 %		
Sijoitukset käyvin arvoihin yhteensä	19 223,2	100,0 %	19 223,2	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio			4,0 vuotta			
Avoin valuuttapositio on			12,3 % sijoitusten arvosta			

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

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