

ETERAN SIJOITUSJAKAUMA JA TUOTOT 31.12.2017

| 31.12.2017, käyvin arvoin | Perusjakauma | | Riskijakauma | | Sitoutuneen pääoman tuotto | Volatiliteetti |
|---|----------------|---------------|----------------|---------------|----------------------------|----------------|
| | milj. € | % | milj. € | % | % | % |
| Korkosijoitukset (ml. johdannaiset) | 2 875,0 | 44,4 % | 2 875,0 | 44,4 % | 2,8 % | |
| Lainasaamiset | 172,0 | 2,7 % | 172,0 | 2,7 % | 4,0 % | |
| Joukkovelkakirjalainat | 1 837,1 | 28,4 % | 1 837,1 | 28,4 % | 4,0 % | 3,0 % |
| Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat | 68,6 | 1,1 % | 68,6 | 1,1 % | 2,2 % | |
| Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat | 1 768,5 | 27,3 % | 1 768,5 | 27,3 % | 4,2 % | |
| Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset | 865,8 | 13,4 % | 865,8 | 13,4 % | -1,9 % | |
| Osakesijoitukset (ml. johdannaiset) | 1 812,2 | 28,0 % | 1 812,2 | 28,0 % | 10,9 % | |
| Noteeratut osakkeet | 1 193,8 | 18,5 % | 1 193,8 | 18,5 % | 11,8 % | 9,5 % |
| Pääomasijoitukset | 518,1 | 8,0 % | 518,1 | 8,0 % | 8,5 % | |
| Noteeraamattomat osakkeet | 100,2 | 1,5 % | 100,2 | 1,5 % | 11,7 % | |
| Kiinteistösijoitukset | 1 267,1 | 19,6 % | 1 249,6 | 19,3 % | 10,0 % | |
| Suorat kiinteistösijoitukset | 998,4 | 15,4 % | 998,4 | 15,4 % | 11,0 % | |
| Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitukset | 268,7 | 4,2 % | 251,2 | 3,9 % | 6,9 % | |
| Muut sijoitukset | 515,9 | 8,0 % | 515,9 | 8,0 % | 0,4 % | |
| Hedge-rahastosijoitukset | 292,9 | 4,5 % | 292,9 | 4,5 % | 1,0 % | 3,6 % |
| Hyödykesijoitukset | 0,0 | 0,0 % | 0,0 | 0,0 % | - | |
| Muut sijoitukset | 223,0 | 3,4 % | 223,0 | 3,4 % | -0,3 % | |
| Sijoitukset yhteensä | | | 6 452,7 | 99,7 % | | |
| Johdannaisten vaikutus | | | 17,5 | 0,3 % | | |
| Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä | 6 470,2 | 100 % | 6 470,2 | 100 % | 6,0 % | 2,1 % |

Joukkovelkakirjalainojen modifioitu duraatio 2,5 vuotta.

Avoin valuuttapositio sijoitusten markkina-arvosta 13,2 %