

Het Spoorwegpensioenfonds heeft over het eerste kwartaal van 2020 een rendement van -7,4% gerealiseerd.

Het gemiddelde rendement van de totale portefeuille over de afgelopen tien jaar komt uit op 6,4%, over de laatste vijf jaren bedraagt het rendement 3,1%.

Financiële specificatie eerste kwartaal 2020

Het Spoorwegpensioenfonds toont de dekkingsgraad op basis van de nFTK-normen. In het nFTK is opgenomen dat pensioenfonds met ingang van 2015 hun beleidsbeslissingen moeten baseren op de beleidsdekkingsgraad. De beleidsdekkingsgraad wordt berekend aan de hand van de dekkingsgraden van elk van de twaalf voorafgaande kalendermaanden en is per 31 januari 2015 voor het eerst gerapporteerd. De beleidsdekkingsgraad is gedaald van 108,1% per 31 december 2019 naar 105,5% ultimo het eerste kwartaal.

Totale portefeuille	Samenstelling vermogen 31-3-2020	Rendement 1e kwartaal portefeuille	Rendement 2020 portefeuille
Aandelen	31%	-21.6%	-21.6%
Staatsobligaties	26%	6.3%	6.3%
Bedrijfsobligaties (IG)	8%	-6.0%	-6.0%
High Yield	2%	-8.6%	-8.6%
Vastgoed	10%	-5.5%	-5.5%
Private Equity	6%	3.0%	3.0%
Hypotheke	8%	1.5%	1.5%
Emerging Markets Debt	6%	-13.2%	-13.2%
Opportunities	1%	-0.7%	-0.7%
Overig	2%		
Totale portefeuille (incl. valuta- en renteafdekking)	100%	-7.4%	-7.4%

Omvang pensioenvermogen	31-3-2020
in € miljard	17.4

Dekkingsgraad	31-3-2020
Beleidsdekkingsgraad (UFR)	105.5%