

Het Spoorwegpensioenfonds heeft over het derde kwartaal van 2019 een rendement van 4,0% gerealiseerd.

Het gemiddelde rendement van de totale portefeuille over de afgelopen tien jaar komt uit op 8,0%, over de laatste vijf jaren bedraagt het rendement 7,1%.

Financiële specificatie derde kwartaal 2019

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 112,7% per 30 juni 2019 naar 109,4% ultimo het derde kwartaal.

Totale portefeuille	Samenstelling vermogen 30-9-2019	Rendement 3e kwartaal portefeuille	Rendement 2019 portefeuille
Aandelen	31%	3.4%	21.6%
Staatsobligaties	25%	7.3%	20.9%
Bedrijfsobligaties (IG)	7%	1.3%	6.6%
High Yield	2%	5.8%	12.5%
Vastgoed	10%	3.9%	10.5%
Private Equity	5%	3.5%	7.7%
Hypotheken	8%	3.7%	5.7%
Emerging Markets Debt	7%	4.6%	14.1%
Opportunities	1%	0.7%	4.5%
Overig	5%		
Totale portefeuille (incl. valuta- en renteafdekking)	100%	4.0%	15.9%

Omvang pensioenvermogen	30-9-2019
in € miljard	18.8

Dekkingsgraad	30-9-2019
Beleidsdekkingsgraad (UFR)	109.4%