

Maandrapportage per 31 augustus 2020

Bedragen x € 1.000

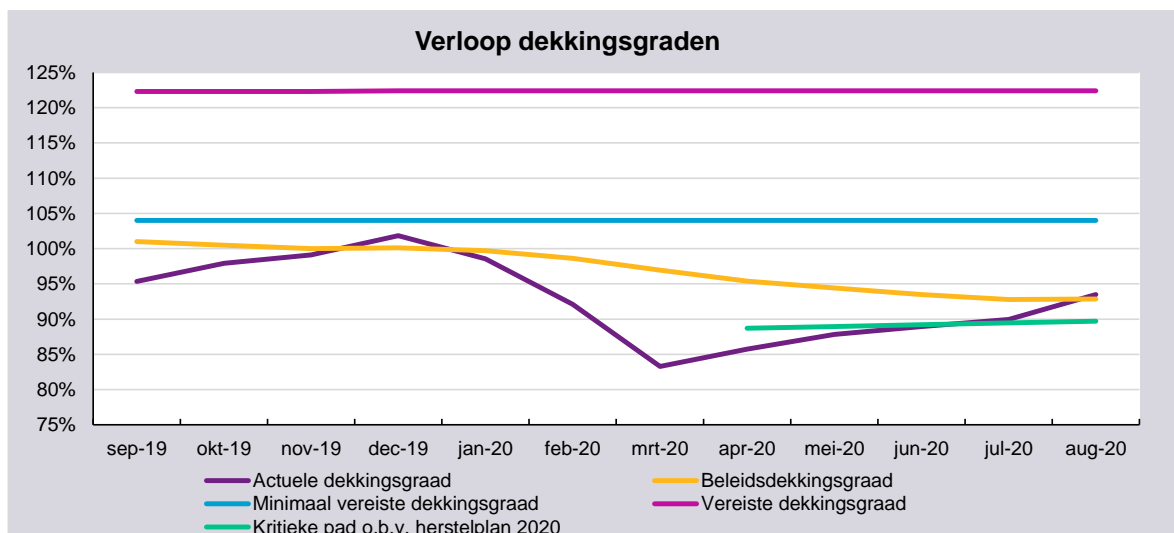
Financiële positie per 31 augustus 2020

	31-7-2020	31-8-2020
Vermogen risico fonds	65.246	66.154
Vermogen deelnemers	11	11
Totaal vermogen	65.257	66.165
TV voor risico fonds	72.549	70.766
TV voor deelnemers	11	11
TV totaal	72.560	70.777
Aanwezige solvabiliteit	-7.303	-4.612
Actuele dekkingsgraad	89,9%	93,5%
Beleidsdekkingsgraad (o.b.v. 12-maandsmiddeling)	92,8%	92,8%
Gemiddelde rente	0,16%	0,28%
Modified duration	19,5	19,2

Toelichting

- Het vermogen is in de maand augustus toegenomen, wat geresulteerd heeft in een toename van de dekkingsgraad.
- De TV zijn in de maand augustus afgenomen, met name als gevolg van een toename van de rentetermijnstructuur, wat geresulteerd heeft in een toename van de dekkingsgraad.
- Per saldo is de actuele dekkingsgraad in augustus met 3,6%-punt toegenomen en is de beleidsdekkingsgraad gelijk gebleven.

Verloop dekkingsgraden



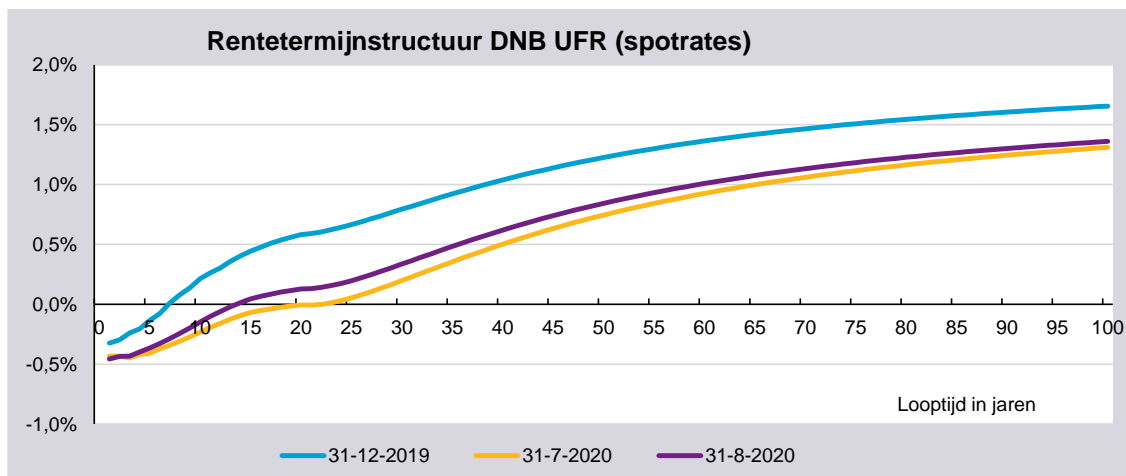
	sep-19	okt-19	nov-19	dec-19	jan-20	feb-20	mrt-20	apr-20	mei-20	jun-20	jul-20	aug-20
Actuele dekkingsgraad	95,3%	97,9%	99,1%	102,4%	99,0%	92,6%	83,8%	85,8%	87,8%	88,9%	89,9%	93,5%
Herijkte dekkingsgraad				101,8%	98,5%	92,1%	83,3%	85,7%				
Beleidsdekkingsgraad	101,0%	100,5%	100,0%	100,1%	99,7%	98,6%	97,0%	95,4%	94,4%	93,5%	92,8%	92,8%

Maandrapportage per 31 augustus 2020

Verloop Technische Voorzieningen en dekkingsgraad

TV per 31-7-2020	72.560	DG per 31-7-2020	89,9%
Interest	-26	Rendement Return portefeuille	2,2%
Uitkeringen	-122	Rendement Matching portefeuille	-0,7%
RTS effect	-1.630	Premie	0,0%
Actualisatie deelnemersbestand	0	Uitkeringen	-0,1%
Overig	-5	RTS effect	2,1%
TV per 31-8-2020	70.777	Overig	0,1%
		DG per 31-8-2020	93,5%

Ontwikkeling rentetermijnstructuur



Overige opmerkingen

- De TV in deze rapportage zijn vastgesteld middels een projectiemethode (kasstromen) gebaseerd op het deelnemersbestand per 30 juni 2020.
- De vermogenscijfers zijn ons aangeleverd door RiskCo. Deze cijfers zijn verder niet door ons gecontroleerd, anders dan op plausibiliteit.