

Stichting Pensioenfonds Huntsman Rozenburg

QuickScan – Maandrapportage september 2016

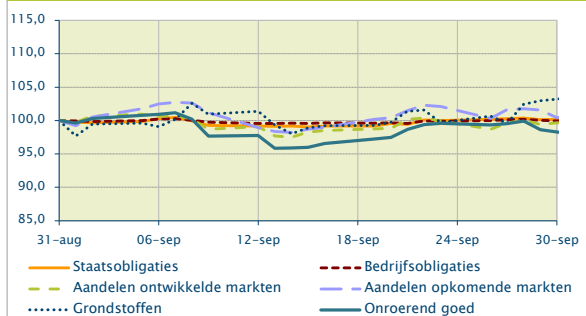


| | Delta | Marktw waarde |
|---------------------------------------|----------|------------------|
| Pensioenvermogen vorige maand | | € 558.725 |
| <i>Mutaties:</i> | | |
| Matching portefeuille | ▲ | € 1.069 |
| Return portefeuille | ▼ | -€ 1.371 |
| Uitkeringen en premies | ▼ | -€ 949 |
| Overig | ▲ | € 1.300 |
| Pensioenvermogen huidige maand | ▲ | € 558.774 |

| | |
|---|----------------|
| Kapitaal risico deelnemers en Herverzekering | € 2.948 |
|---|----------------|

Matching +0,4%
Return -0,5%

Ontwikkeling beleggingscategorieën (indices)



Ontwikkeling fonds:

Vooralsnog is er geen rekening gehouden met de aanpassing inzake de Prognosetafel AG2016.

| |
|----------------------------|
| DG o.b.v. Swaprente |
| DG vorige maand |
| 107,2% |
| ▲ 0,4% |

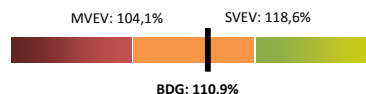
| |
|---|
| 107,6% |
| Swap dekkinggraad september 2016 |

| |
|-------------------------------|
| DG t.o.v. vorige maand |
| 111,8% |
| ▲ 0,2% |

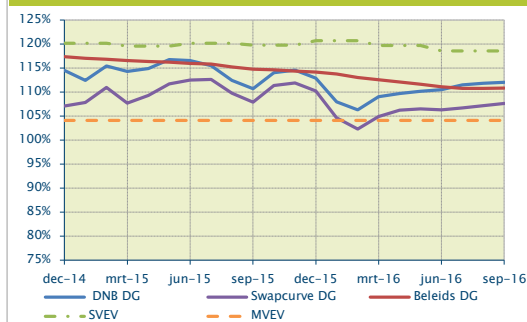
| |
|------------------------------------|
| 112,0% |
| Dekkinggraad september 2016 |

| |
|----------------------------|
| Beleidsdekkinggraad |
| DG vorige maand |
| 110,7% |
| ▲ 0,2% |

| |
|---|
| 110,9% |
| Beleidsdekkinggraad september 2016 |



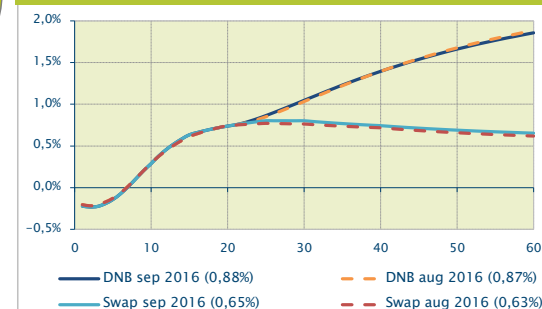
Ontwikkeling financiële positie



| | Delta | Marktw waarde |
|----------------------------------|----------|------------------|
| Voorziening vorige maand | | € 499.357 |
| <i>Mutaties:</i> | | |
| Rente | ▲ | € 69 |
| Uitkeringen en premies | ▼ | -€ 942 |
| Overige effecten | ▲ | € 0 |
| Voorziening huidige maand | ▼ | € 498.484 |

| | |
|---|----------------|
| TV risico deelnemers en Herverzekering | € 2.948 |
|---|----------------|

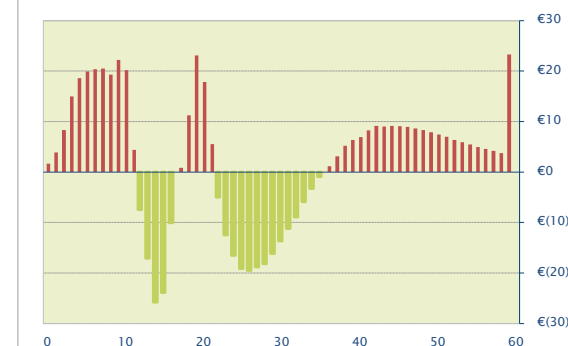
Rentetermijnstructuur



Duration 16,1

DNB rente +0,01%

Impact RTS op voorziening (in duizenden)



| | Delta | Marktw waarde |
|--------------------------------|-------|---------------|
| Pensioenvermogen vorige maand | | € 558.725 |
| <i>Mutaties:</i> | | |
| Matchin | | € 1.069 |
| Return | | -€ 1.371 |
| Uitkering en premie | ▲ | -€ 949 |
| Overig | ▲ | € 1.300 |
| Pensioenvermogen huidige maand | ▲ | € 558.774 |

In dit blok wordt het verloop van het vermogen getoond.

De pijl geeft de wijziging van het vermogen weer ten opzichte van vorige maand.

| Delta | Marktw waarde |
|--|---------------|
| DG o.b.v. Swaprente | |
| In dit blok wordt de huidige dekingsgraad o.b.v. de swaprente weergegeven. | |
| Swap dekingsgraad september 2016 | |

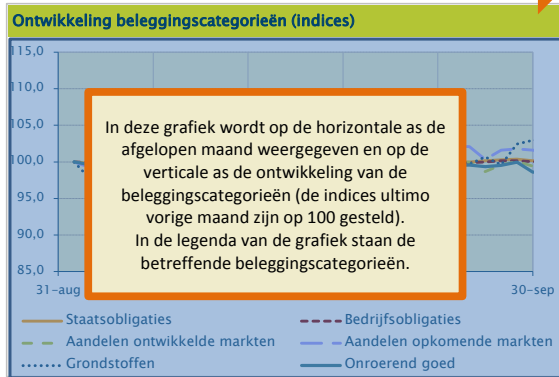
Hier wordt de dekingsgraad van vorige maand weergegeven en de wijziging t.o.v. vorige maand.

In dit blok wordt de huidige dekingsgraad o.b.v. de DNB-rente weergegeven.

| | Delta | Marktw waarde |
|---------------------------|-------|---------------|
| Voorziening vorige maand | | € 499.357 |
| <i>Mutaties:</i> | | |
| Rent | | € 9 |
| Uitkeringen en premies | ▲ | -€ 942 |
| Overige effecten | ▲ | € 0 |
| Voorziening huidige maand | ▼ | € 498.484 |

In dit blok wordt het verloop van de voorziening getoond.

De pijl geeft de wijziging van de voorziening weer ten opzichte van vorige maand.

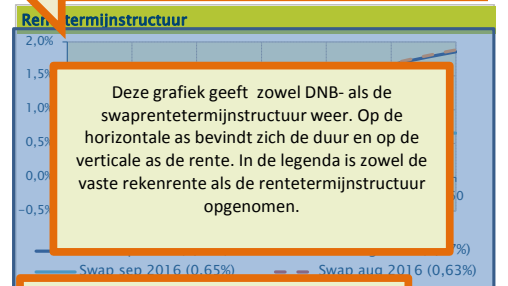


Ontwikkeling fonds:
Vooral nog is er geen rekening gehouden met de aanpassing inzake de Prognosetafel AG2016.

Dit tekstblok geeft een beschrijving van de fondsspecifieke ontwikkeling in de afgelopen maand.

| Delta | Marktw waarde |
|---|---------------|
| Beleidsdekingsgraad | |
| In dit blok wordt de huidige beleidsdekingsgraad weergegeven. | |
| Beleidsdekingsgraad september 2016 | |

In deze grafische weergave wordt de dekingsgraad t.o.v. het minimaal vereist eigen vermogen en het strategisch vereist eigen vermogen afgezet. Het minimaal en het strategisch VEV wordt na het passeren van de Jaarwerkvergadering (dan wel het rapporteren aan de DNB in het kader van de K-staten) geactualiseerd.



De pijlen geven met groen of rood respectievelijk een stijging of een daling weer. De 2 pijlen rechts onder (tussen DNB-rentetermijnstructuur en Impact RTS op voorziening (in duizenden)) tonen respectievelijk de duration en de rentewijziging t.o.v. vorige maand.

