

BIJLAGE 1a: Belegd pensioenvermogen voor risico pensioenfondsen

Datum laatste wijziging: 20-09-2012													
Totaal pensioenfondsen													
Ultimocijfers in miljoenen euro's													
	2011K1		2011K2		2011K3		2011K4		2012K1		2012K2		
	Excl. Derivaten	Incl. Derivaten	Excl. Derivaten	Incl. Derivaten	Excl. Derivaten	Incl. Derivaten	Excl. Derivaten	Incl. Derivaten	Excl. Derivaten	Incl. Derivaten	Excl. Derivaten	Incl. Derivaten	
Vastgoedbeleggingen													
1.1.1	Directe beleggingen in vastgoed	17.599	17.599	17.413	17.413	17.510	17.510	18.221	18.221	14.831	14.831	14.883	14.883
1.1.2	Indirecte beleggingen in vastgoed	61.498	61.500	61.418	61.419	59.365	59.363	63.780	63.777	62.602	62.602	65.230	65.230
1.1.2.1	W.v. beursgenoteerd									29.607	29.607	31.201	31.201
1.1.2.2	W.v. niet-beursgenoteerd									32.995	32.995	34.029	34.029
1	Totaal vastgoedbeleggingen	79.097	79.098	78.831	78.831	76.875	76.873	82.001	81.998	77.432	77.432	80.113	80.113
Aandelen													
2.1.1	Mature markets	182.747	183.867	184.433	185.712	173.523	174.620	185.432	188.329	198.540	199.730	201.460	202.748
2.1.2	Emerging markets	38.246	38.267	38.974	38.982	34.640	34.619	40.342	40.344	49.760	49.765	44.485	44.497
2.1.3	Beleggingsfondsen	9.044	9.557	8.751	9.235	3.444	3.888	4.260	4.719				
2	Totaal aandelen	230.037	231.691	232.158	233.929	211.607	213.127	230.034	233.392	248.300	249.495	245.945	247.245
3	Private equity	26.821	26.821	27.289	27.289	29.392	29.392	29.978	29.978	38.453	38.453	40.885	40.885
Vastrentende waarden													
4.1.1	Staatsobligaties, niet index-linked	142.468	143.041	148.515	149.188	160.769	193.664	173.103	218.610	187.604	233.587	195.674	250.600
4.1.2	Index-linked bonds	40.106	39.788	42.144	41.860	42.237	40.445	40.821	40.244	41.015	39.630	41.614	38.956
4.1.3	Hypothecaire leningen	33.753	33.751	33.863	33.864	32.850	32.853	31.204	31.208	33.950	33.955	33.304	33.310
4.1.4	Credits	111.050	110.041	109.377	109.043	110.020	111.797	114.335	115.039	115.943	115.940	119.710	119.748
4.1.5	Kortlopende vorderingen op banken	13.924	19.906	12.111	13.267	16.548	9.408	11.544	6.493	19.785	19.819	18.624	18.648
4.1.6	Beleggingsfondsen	6.244	6.507	6.023	6.347	2.654	3.487	2.473	3.495				
4	Totaal vastrentende waarden	347.545	353.034	352.032	353.569	365.078	391.654	373.481	415.089	398.298	442.930	408.926	461.262
5	Hedge funds	23.817	23.817	24.252	24.255	26.408	26.408	25.782	25.782	25.382	25.441	27.109	27.141
6	Commodities	10.911	12.341	10.491	10.985	9.841	8.805	5.521	5.782	2.311	2.941	2.105	1.705
Overige beleggingen													
7.1.1	Securities lending en repo									-8.790	-8.790	-9.044	-9.044
7.1.2	Herbelegging vanuit securities lending en repo									8.236	8.236	8.177	8.177
7.1.3	Overige liquide middelen	17.692	18.473	22.376	22.478	21.627	21.386	23.358	23.119	16.074	15.732	14.298	14.286
7.1.4	Overig	-4.421	-2.293	-5.267	-3.430	-9.670	-3.283	-13.085	-13.523	-10.320	-10.473	-14.260	-14.468
7.1.5	Beleggingsfondsen	840	759	1.148	1.058	527	575	528	586				
7	Totaal overige beleggingen	14.111	16.939	18.257	20.106	12.484	18.678	10.801	10.182	5.200	4.705	-829	-1.049
8	Currency overlay									0	2.171	0	-2.066
9	Totaal beleggingen voor risico fonds	732.339	743.740	743.310	748.965	731.685	764.937	757.597	802.204	795.375	843.568	804.255	855.237

BIJLAGE 1b: Marktwarde derivatenposities belegd pensioenvermogen

Datum laatste wijziging: 20-09-2012							
Totaal pensioenfondsen							
Ultimocijfers in miljoenen euro's							
		2011K1	2011K2	2011K3	2011K4	2012K1	2012K2
Derivatenposities							
1	Rentederivaten		1.983	2.949	40.679	49.036	50.025
2	Aandelencontracten		909	1.069	1.684	1.451	1.527
3	Valutacontracten		7.396	1.463	-8.278	-6.198	-2.036
4	Commodities derivaten		1.432	498	-1.055	220	-400
5	Kredietderivaten		-318	-323	222	95	-106
6	Derivaten met exposure naar meerdere factoren		0			1.219	1.972
	Totaal derivaten positie		11.403	5.655	33.252	44.604	50.982