

ESG Risicobeoordeling Q4 2020

De ESG-risicobeoordelingen meten de mate waarin de economische waarde van een bedrijf risico loopt op basis van onderliggende ESG-factoren. Deze ESG-risicobeoordeling bestaat uit een kwantitatieve score en een risicocategorie. De kwantitatieve score vertegenwoordigt eenheden van onbeheerd ESG-risico waarbij een lagere score een lager onbeheerd risico betekent. Het onbeheerd risico wordt gemeten op een schaal van 0 - 100. Waarbij 95% van de bedrijven een maximale score van onder de 50 heeft. Op basis van de behaalde score wordt een bedrijf geplaatst in een risicocategorie. Deze scores zijn absoluut wat betekent dat een bank bijvoorbeeld direct vergeleken kan worden met een oliemaatschappij.

Onderstaande figuren geven een beeld van de duurzaamheidsprestaties en samenstelling van de Menzis portefeuille ten opzichte van het standaard universum (benchmark), die bestaat uit 3500 large-cap bedrijven uit ontwikkelde markten.

Aandelen Portefeuille Menzis t.o.v. Benchmark

Portfolio	Overall Risk Rating Score	Category
Portfolio	21.3	Medium
Benchmark	24.3	Medium

ESG Risk Categories

Negligible: 0 - 10
Negligible risk of material financial impacts driven by ESG factors

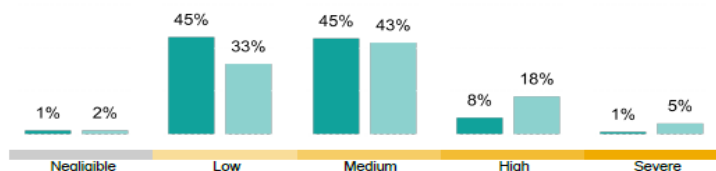
Low: 10 - 20
Low risk of material financial impacts driven by ESG factors

Medium: 20 - 30
Medium risk of material financial impacts driven by ESG factors

High: 30 - 40
High risk of material financial impacts driven by ESG factors

Severe: > 40 - 100
Severe risk of material financial impacts driven by ESG factors

ESG Risk Category by aggregate portfolio weight %



Powered by Sustainalytics

Het ESG-risico van de aandelen portefeuille van Menzis wordt met een overall risk rating score van 21.3, beschouwd als "medium" en is 13% lager dan de benchmark. De prevalentie van bedrijven met een ernstig risico in de portefeuille is 78% lager dan de benchmark.

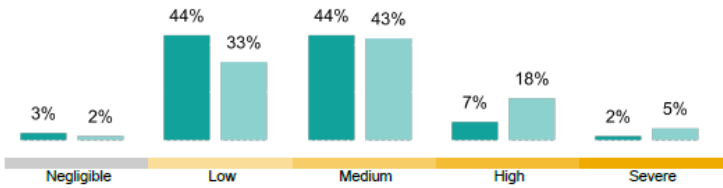
Bedrijfsobligatie Portefeuille Menzis t.o.v. Benchmark

	Overall Risk Rating Score	Category
Portfolio	21.5	Medium
Benchmark	24.3	Medium

ESG Risk Categories

- Negligible: 0 - 10**
Negligible risk of material financial impacts driven by ESG factors
- Low: 10 - 20**
Low risk of material financial impacts driven by ESG factors
- Medium: 20 - 30**
Medium risk of material financial impacts driven by ESG factors
- High: 30 - 40**
High risk of material financial impacts driven by ESG factors
- Severe: > 40 - 100**
Severe risk of material financial impacts driven by ESG factors

ESG Risk Category by aggregate portfolio weight %



Powered by Sustainalytics

Ook het ESG-risico van de bedrijfsobligatie portefeuille van Menzis wordt met een overall risk rating score van 21.5, beschouwd als “medium” en is 12% lager dan de benchmark. De prevalentie van bedrijven met een ernstig risico in de portefeuille is 64% lager dan de benchmark.

De ESG risico’s worden nauw gemonitord. Deze scores bieden ons nieuwe inzichten die wij gebruiken en vertalen naar criteria voor ons beleggingsbeleid.

Copyright ©2021 Sustainalytics. All rights reserved.

This [disclosure/ report/ section] references data provided by Sustainalytics (www.sustainalytics.com). Such data and opinions are proprietary of Sustainalytics and/or its third-party suppliers (Third Party Data), are provided for informational purposes only, do not constitute an endorsement of any product or project, nor an investment advice and are not warranted to be complete, timely, accurate or suitable for a particular purpose. Their use is subject to conditions available at <https://www.sustainalytics.com/legal-disclaimers/>

