

Duurzaamheid & strategische asset allocatie

CoP FinC

Frank Wagemans

Vereniging van beleggers voor duurzame ontwikkeling (VBDO)

14 juni 2016

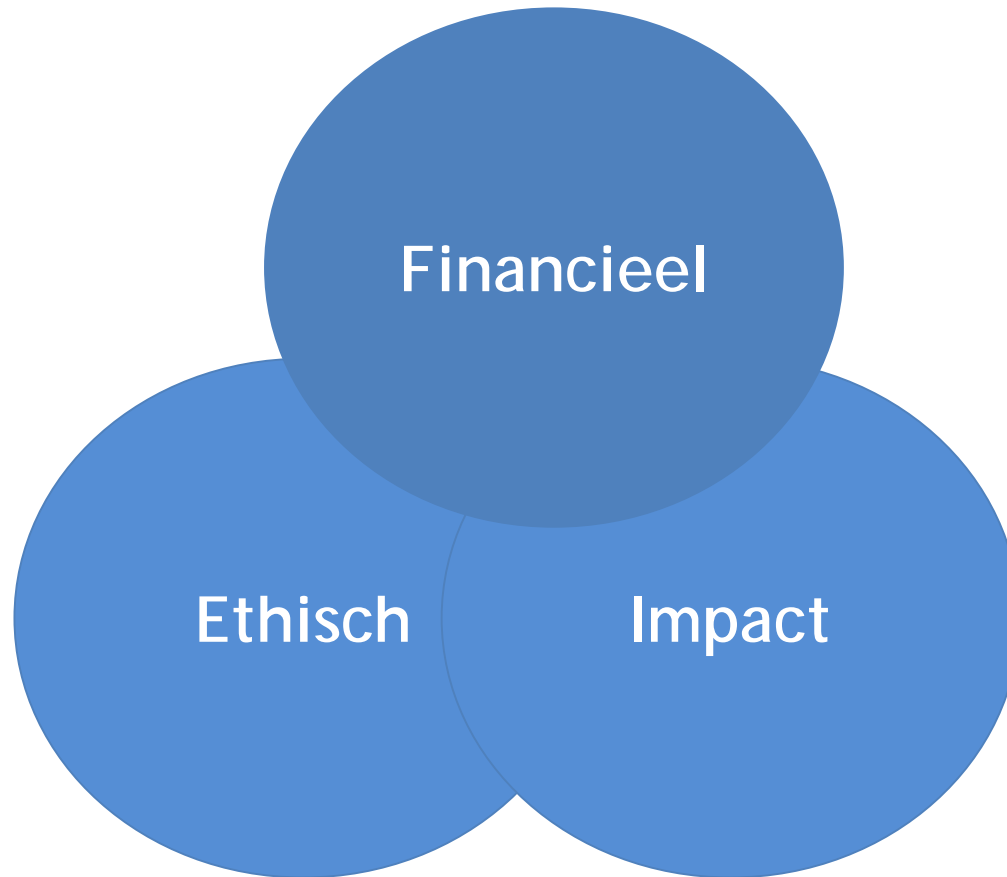


Duurzaamheid & Strategische asset allocatie: wat is het?



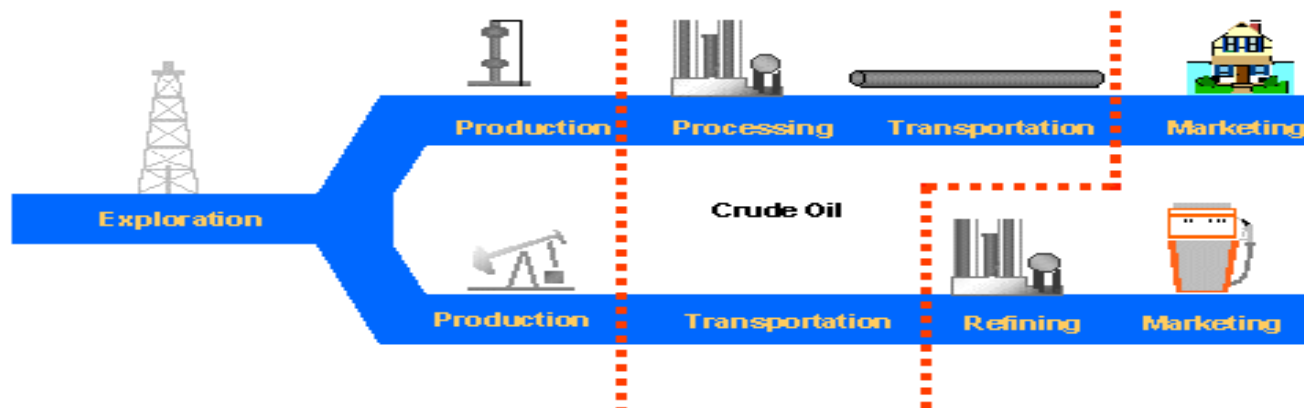
Het meenemen van duurzaamheidstrends in strategische beleggingsbeslissingen zoals asset- en sector allocatie.

Invalshoeken voor duurzaam beleggen



ESG-integratie: het hoe i.p.v. het wat

- ESG-integratie vaak gefocust op processen;
 - De vraag naar producten.
 - Financiële risico's voor sectoren.
 - Nieuwe concurrentie of juist nieuwe markten.



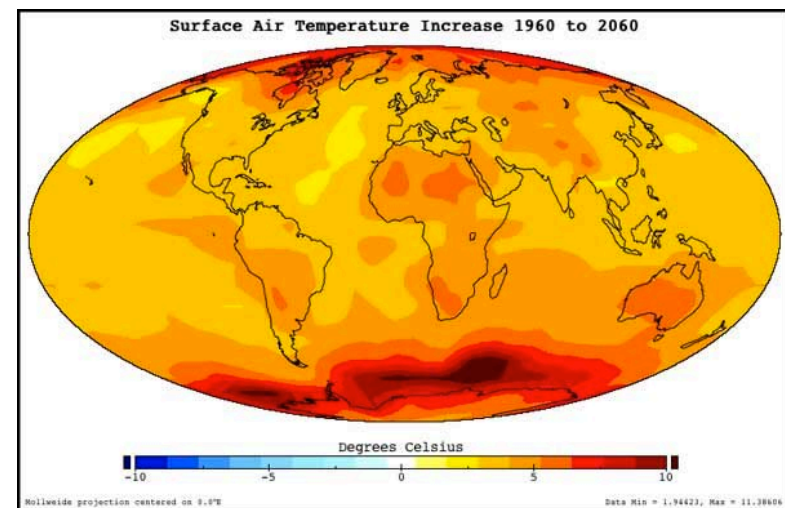
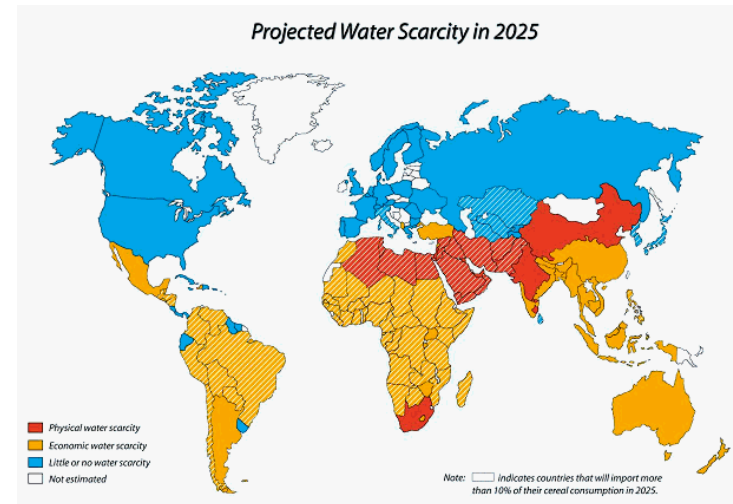
ESG-integratie: Op individuele titels

- ESG-integratie wordt veel minder betrokken bij meer strategische beleggingsbeslissingen:
 - 26% van pensioenfondsen laat dit enigszins meewegen rol bij sector-allocatie of asset allocatie.
 - Neemt geen trends in beschouwing.

Relevante thema's



- Grondstoffen
- Bevolkingsgroei
- Water schaarste
- Vergrijzing
- Klimaatsverandering



Impact



Klimaatsverandering

- Directe impact:**
- Voedselproductie
 - Energie gebruik
 - Verzekeringen
 - Sociale onrust

- Indirecte impact:**
- Transitie naar duurzame energie
 - Mitigatie
 - Carbon bubble

Sustainability and strategic investment decisions

Verschillende initiatieven ontwikkelen zich



Platform Carbon Accounting
Financials

Verschillende instrumenten ontwikkelen zich



Verschillende instrumenten ontwikkelen zich:



Maar gebruik van deze instrumenten is nog geen common practice

Vervolgstappen



Programma “sustainability and strategic asset allocation”

- Vergroten bewustwording op het thema
- Ontwikkelen van tools om het thema effectiever te integreren
 - Scenario analyse
 - Models
 - Methoden om risico in portfolio's te

Om dit programma te starten is VBDO

- Die expertise in willen brengen en willen
- Actief in het programma willen deelnemen met investeerders en experts

Contact en meer informatie

Frank.Wagemans@vbdo.nl

VBDO
Pieterstraat 11
3512 JT Utrecht
030 234 00 31



www.vbdo.nl