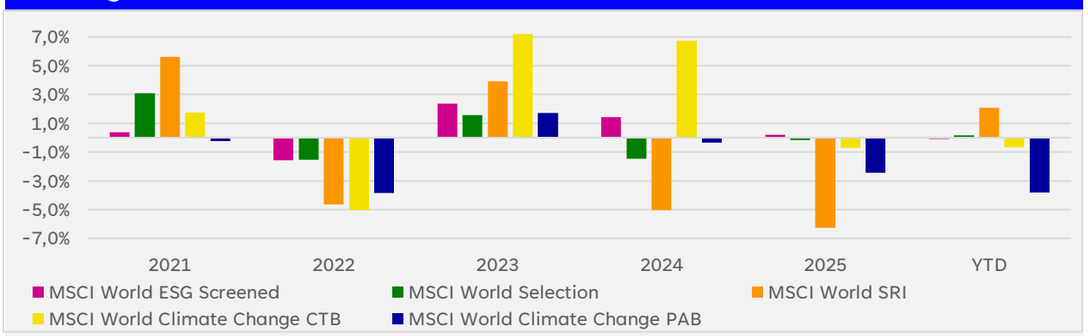
Sprenkels

In control komen en blijven

Vergelijking ESG-benchmarks versus reguliere benchmarks

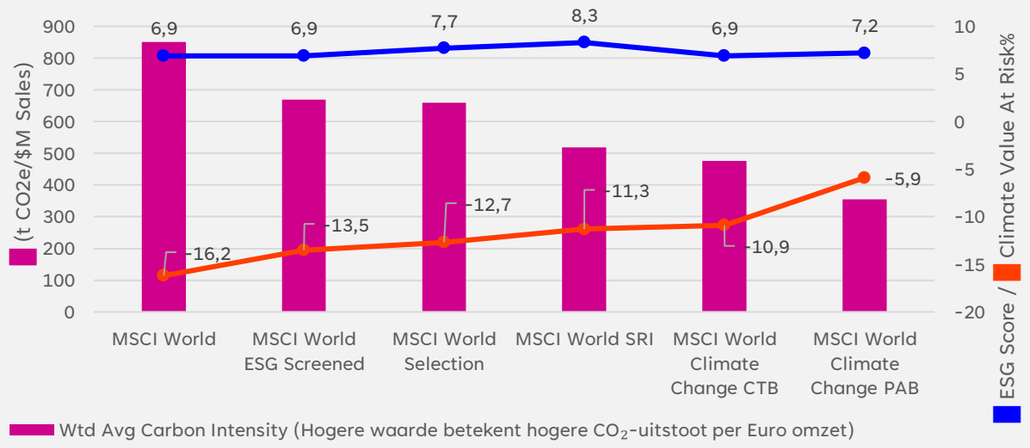
Q3 2026

Figuur 1: Aandelen ontwikkelde markten t.o.v. MSCI World

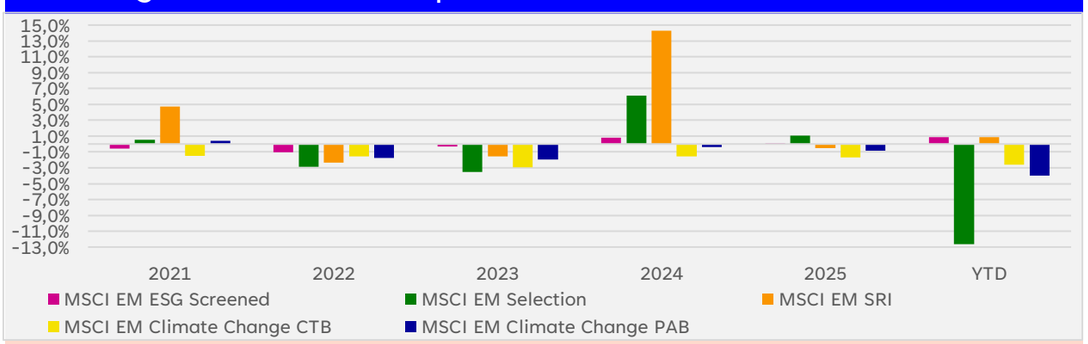


Rendement t.o.v. MSCI World	Q	1Y	3Y	5Y	Volatiliteit	3Y	5Y
MSCI World	2,5%	19,2%	18,6%	12,3%		11,4%	13,2%
ESG Screened	0,0%	0,1%	0,7%	0,3%		0,7%	0,6%
Selection	0,0%	1,2%	-0,3%	-0,1%		0,9%	0,6%
SRI	-2,6%	0,5%	-2,8%	-1,5%		2,2%	2,1%
Climate Change CTB	0,0%	-0,4%	1,9%	1,1%		1,8%	1,8%
Climate Change PAB	0,5%	-4,4%	-1,8%	-2,0%		0,8%	1,0%

Figuur 2: ESG kenmerken aandelen ontwikkelde markten

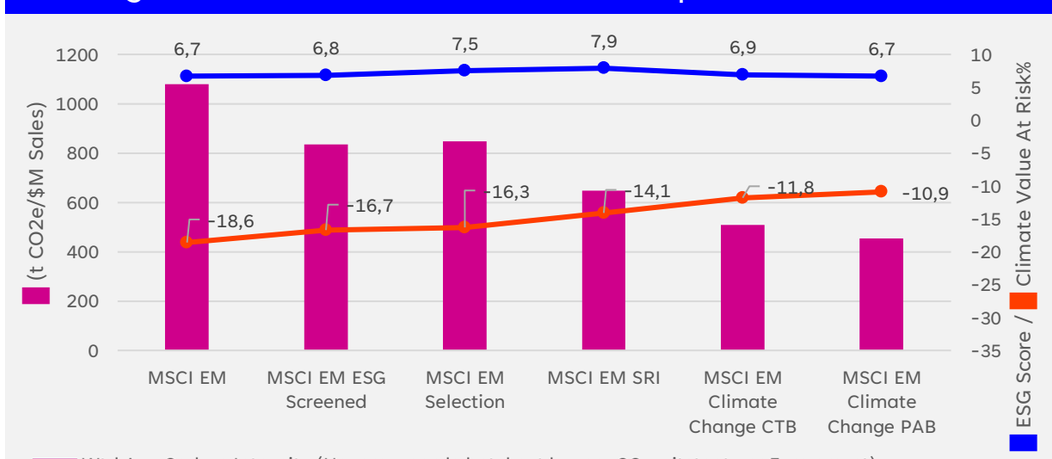


Figuur 3: Aandelen opkomende markten t.o.v. MSCI EM

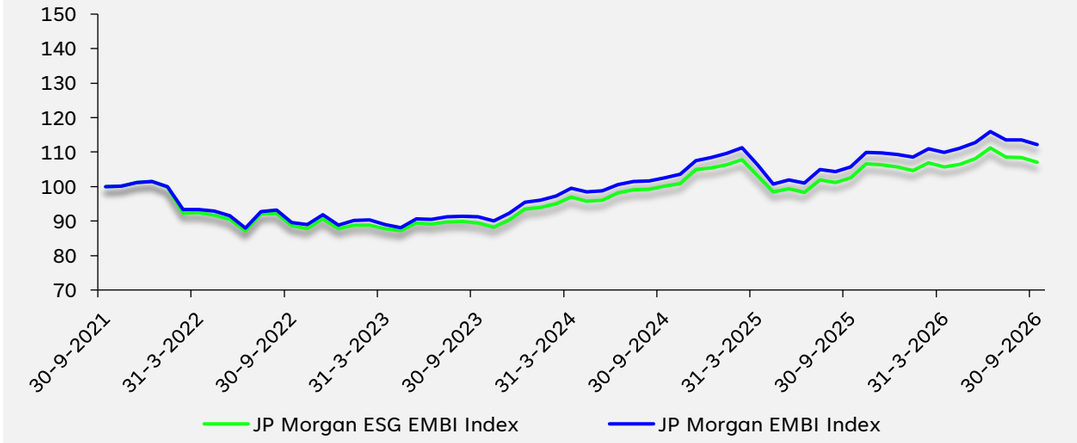


Rendement t.o.v. MSCI EM	Q	1Y	3Y	5Y	Volatiliteit	3Y	5Y
MSCI EM	0,3%	33,7%	21,2%	9,4%		15,7%	15,5%
EM ESG Screened	-0,1%	0,9%	0,6%	-0,1%		0,3%	0,3%
EM Selection	0,4%	-16,2%	-2,2%	-2,6%		-2,3%	-0,5%
EM SRI	-0,1%	1,5%	5,0%	1,8%		0,2%	1,8%
EM Climate Change CTB	-1,7%	-5,5%	-2,5%	-2,2%		0,8%	0,9%
EM Climate Change PAB	-1,6%	-4,5%	-1,6%	-1,6%		-0,4%	-0,2%

Figuur 4: ESG kenmerken aandelen opkomende markten

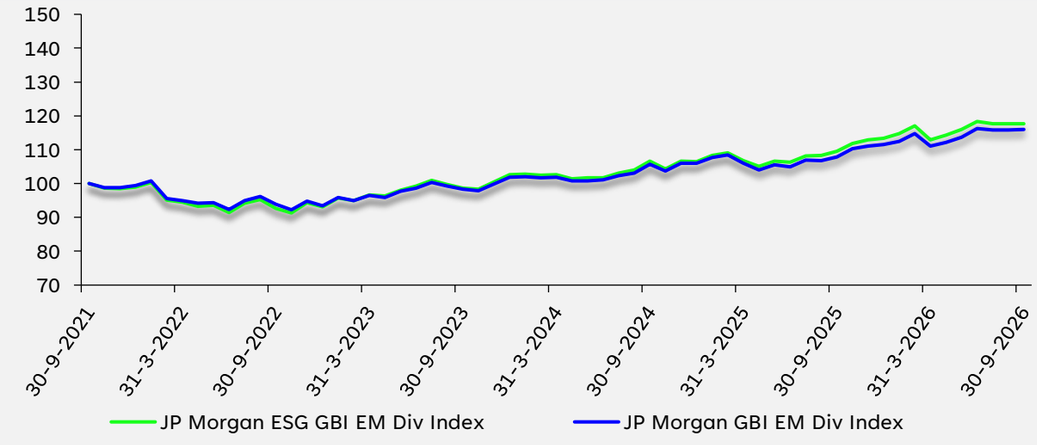


Figuur 5: EMD HC



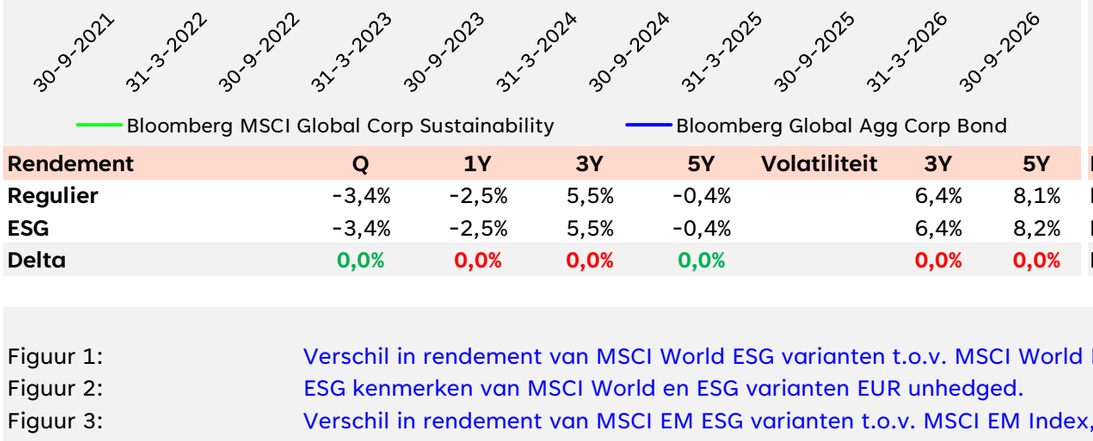
Rendement	Q	1Y	3Y	5Y	Volatiliteit	3Y	5Y
Regulier	-3,2%	6,1%	7,2%	2,3%		7,0%	7,8%
ESG	-3,7%	4,4%	6,2%	1,4%		7,0%	7,9%
Delta	-0,5%	-1,7%	-1,0%	-1,0%		-0,1%	0,1%

Figuur 6: EMD LC



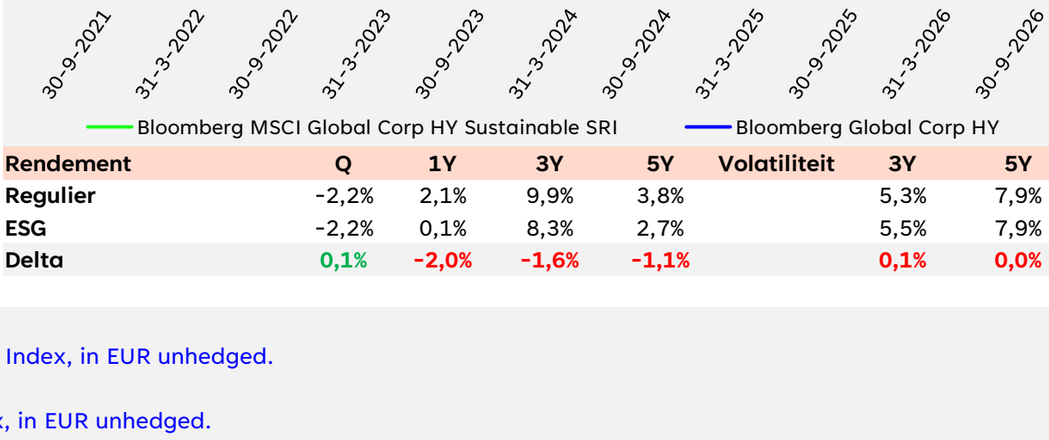
Rendement	Q	1Y	3Y	5Y	Volatiliteit	3Y	5Y
Regulier	-0,3%	7,5%	5,7%	3,0%		4,8%	5,6%
ESG	-0,6%	7,4%	6,1%	3,3%		4,9%	5,8%
Delta	-0,3%	-0,1%	0,4%	0,3%		0,1%	0,2%

Figuur 7: Bedrijfsobligaties Global



Rendement	Q	1Y	3Y	5Y	Volatiliteit	3Y	5Y
Regulier	-3,4%	-2,5%	5,5%	-0,4%		6,4%	8,1%
ESG	-3,4%	-2,5%	5,5%	-0,4%		6,4%	8,2%
Delta	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%		0,0%	0,0%

Figuur 8: High yield Global



Rendement	Q	1Y	3Y	5Y	Volatiliteit	3Y	5Y
Regulier	-2,2%	2,1%	9,9%	3,8%		5,3%	7,9%
ESG	-2,2%	0,1%	8,3%	2,7%		5,5%	7,9%
Delta	0,1%	-2,0%	-1,6%	-1,1%		0,1%	0,0%

Figuur 1:	Verschil in rendement van MSCI World ESG varianten t.o.v. MSCI World Index, in EUR unhedged.
Figuur 2:	ESG kenmerken van MSCI World en ESG varianten EUR unhedged.
Figuur 3:	Verschil in rendement van MSCI EM ESG varianten t.o.v. MSCI EM Index, in EUR unhedged.
Figuur 4:	ESG kenmerken van MSCI EM en ESG varianten EUR unhedged.
Figuur 5:	JPMorgan EMBI Global Diversified en JPMorgan ESG EMBI Global Diversified, in EUR unhedged.
Figuur 6:	JPMorgan GBI-EM Glb Diversified (LC) Index en JPMorgan ESG GBI-EM Glb Diversified (LC) Index, in EUR unhedged.
Figuur 7:	Bloomberg Global Aggregate Corporate Bond Index en Bloomberg MSCI Global Corporate Sustainability Index, in EUR, unhedged.
Figuur 8:	Bloomberg Global Corporate High Yield Index en Bloomberg MSCI Global Corporate High Yield Sustainable SRI Index, in EUR, unhedged.
Wtd Carbon Intensity	Gewogen gemiddelde Scope 1-, Scope 2- en Scope 3-koolstofemissie-intensiteit, genormaliseerd op basis van omzet.
ESG Score	Gewogen gemiddelde ESG-score. De ESG-score geeft aan hoe goed de indexcomponenten hun meest materiële ESG-risico's beheren vergeleken met sectorgenoten.
Agg. Climate VAR%	Geaggregeerde klimaat 'Value-at-Risk' (VaR):betreft de som van de beleidsrisico klimaat-VaR, de technologische kansen klimaat-VaR en de fysieke klimaatrisico-VaR, zoals beschikbaar via de website van MSCI

Mocht u vragen hebben of mocht u zich willen aanmelden voor de wekelijkse e-mailservice, dan kunt u ons bereiken via investments@sprenkels.nl of www.sprenkels.nl

© 2026 Sprenkels. Eigendomsrecht en vertrouwelijk. Uitsluitend voor gebruik door Sprenkels en klanten van Sprenkels.