

# Citi Global Equity ESG Focus Portfolio

## Zusammenfassung der Offenlegung auf der Website

Die EU-Offenlegungsverordnung (SFDR) schreibt vor, dass wir Angaben im Rahmen unserer vorvertraglichen Informationen in Bezug auf ein Finanzprodukt, das ökologische und/oder soziale Merkmale bewirbt, sowie bestimmte andere Informationen, die auf einer Internetseite veröffentlicht werden, zusammenfassen. Diese Offenlegung erfolgt zu diesen Zwecken durch Citibank Europe plc im Hinblick auf Kunden ihrer Luxemburger Niederlassung in Bezug auf das Citi Global Equity ESG Focus Portfolio.

### **Kein nachhaltiges Investitionsziel**

Dieses Finanzprodukt fördert ökologische oder soziale Merkmale, hat aber kein nachhaltigen Investitionen angestrebt.

### **Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts**

Dieses Finanzprodukt fördert die Unterstützung der Prinzipien des UN Global Compact (UNGC) und sind darauf ausgerichtet, Investitionen in bestimmte Aktivitäten zu vermeiden, die potenziell die Gesundheit und das Wohlbefinden von Menschen beeinträchtigen können, indem verbindliche Ausschlüsse angewendet werden.

### **Anlagestrategie**

Im Anlageauswahlprozess werden unter Verwendung von Daten externer ESG-Datenanbieter und/oder der Bewertung von CIM die folgenden verbindlichen ESG-Elemente angewendet:

- (i) es wird ein ESG-Positiv-Screening in Bezug auf das Anlageuniversum vorgenommen, um sicherzustellen, dass die Investitionen ein günstiges ESG-Rating (wie von unseren externen ESG-Datenanbietern definiert) aufweisen; und
- (ii) es gelten die folgenden Ausschlüsse: (a) Unternehmen, die den UNGC-Grundsätzen nicht entsprechen oder von unseren externen ESG-Datenanbietern und/oder CIM als nicht UNGC-konform angesehen werden; (b) Unternehmen, die (im vorherigen Geschäftsjahr) mehr als 10 % ihrer Umsätze mit bestimmten Aktivitäten erwirtschaften; und (c) Unternehmen mit einer direkten oder indirekten Verbindung zur Herstellung oder zum Vertrieb umstrittener Waffen.

In Einzelfällen kann CIM die ESG-Bewertung des externen Datenanbieters durch eine eigene ergänzen. Auf der Grundlage unserer internen Fundamentalbewertung können wir Positionen in Finanzprodukten aufnehmen, die auf der Grundlage der Daten von Drittanbietern eine der oben genannten zwingenden Voraussetzungen nicht zu erfüllen scheinen, wenn wir der Ansicht sind, dass die Daten von Drittanbietern unzureichend, unvollständig oder ungenau sind und das Unternehmen auf der Grundlage unserer eigenen Fundamentalanalyse die oben genannten zwingenden Voraussetzungen erfüllt. Ähnlich verfahren wir bei Emittenten, die nicht von einem Drittanbieter abgedeckt werden. Ebenso können wir Positionen ausschließen, die eines oder mehrere der oben genannten Kriterien zu erfüllen scheinen, bei denen wir auf der Grundlage unserer eigenen Fundamentalbewertung oder anderer Datenquellen jedoch nicht mit den Daten des Drittanbieters übereinstimmen.

Die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei Unternehmen, in die investiert wird, werden auf Basis eines ESG-Datenratings Dritter auch im Due-Diligence-Prozess für Investitionen berücksichtigt. Weitere Informationen finden Sie in der vollständigen Offenlegung auf der Internetseite.

### **Aufteilung der Investitionen**

Für das Finanzprodukt gilt verpflichtend ein Mindestanteil von 80 % an Investitionen, die den von den Finanzprodukten beworbenen Merkmalen entsprechen. Der verbleibende Teil der Investitionen der Finanzprodukte besteht aus Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten, einschließlich von Geldmarktfonds ausgegebenen Wertpapieren, die zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements gehalten werden. Mit den Finanzprodukten werden keine nachhaltigen Investitionen angestrebt und die EU-Taxonomie wird dabei nicht berücksichtigt, so dass 0 % des Finanzprodukts taxonomiekonform ist. Es ist davon auszugehen, dass ausschließlich direkte Anlagen in Unternehmen getätigt werden, in die investiert wird.

### **Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale**

Die Anlagestrategie des Finanzprodukts wird durch einen Anlageprozess umgesetzt, mit dem jährlich die ESG-Bewertungen des Finanzprodukts und monatlich die Ausschlussdaten aktualisiert werden, auf deren Grundlage wir unsere Investitionsentscheidungen treffen. Ergänzt wird dies durch die eigene Bewertung von CIM. Damit wird sichergestellt, dass die Investitionen für die Finanzprodukte an den verbindlichen Elementen ausgerichtet sind, die bei diesem Produkt zur Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale verwendet werden.

### **Methoden**

Der MSCI World Index wird verwendet, um ein Basisuniversum für die Finanzprodukte zu generieren, auf das ein Positiv-Screening in Bezug auf das ESG-Rating sowie ESG-

Ausschlussfilter auf der Grundlage von ESG-Ratings und Daten Dritter angewendet werden. Die ESG-Ratings werden von dem Datenanbieter in Abhängigkeit davon festgelegt, wie stark ein Unternehmen wesentlichen ESG-Risiken ausgesetzt ist und wie gut es sein Risiko steuert. Die Datenpunkte für die Ausschlusskriterien werden durch den externen Datenanbieter nach Maßgabe der Geschäftstätigkeit des Unternehmens bestimmt. In Einzelfällen kann CIM die ESG-Bewertung des externen Datenanbieters durch eine eigene ergänzen. Weitere Informationen finden Sie in der vollständigen Offenlegung auf der Internetseite.

#### **Datenquellen und -verarbeitung**

Das ESG-Positiv-Screening und die ESG-Ausschlüsse werden auf Basis von ESG-Ratings und Daten von Sustainalytics angewendet. Die relevanten Daten werden über die Internetseite des Anbieters oder einen monatlichen Datenfeed von dem Anbieter bezogen und in dem Anlageprozess, bei dem das Anlageuniversum definiert wird, sowie zur regelmäßigen Überwachung (s.o.) verwendet. Da wir Daten Dritter nutzen, um die ökologischen und sozialen Merkmale des Finanzprodukts zu erfüllen, schätzen wir selbst keine Daten. Wir sind uns bewusst, dass Sustainalytics aufgrund fehlender Daten einen geringen Teil der ESG-Daten, die wir erhalten, schätzt.

CIM kann auch auf andere öffentlich zugängliche Quellen sowie auf Research von externen Brokern und Informationen aus Gesprächen mit dem Unternehmensmanagement zurückgreifen.

#### **Einschränkungen bei Methoden und Daten**

Es bestehen generelle Probleme im Zusammenhang mit ESG-Daten, die unserer Einschätzung nach auch für die Daten gelten, die wir von unserem Datenanbieter beziehen – dazu gehören (unter anderem) Datenlücken, Verzögerungen aufgrund von Meldefristen, divergierende Methoden zwischen Datenanbietern und Datenquellen für die Berechnung oder Schätzung der Daten und Abweichungen zwischen geschätzten und gemeldeten Daten. Da es sich hierbei um allgemeine Einschränkungen am Markt und nicht um für die Finanzprodukte oder unsere ausgewählten Datenanbieter spezifische Einschränkungen handelt, sind wir der Ansicht, dass wir die von den Finanzprodukten beworbenen Merkmale noch angemessen erfüllen können. Wir führen auch einen internen Überprüfungs- und Genehmigungsprozess für Anbieter durch, im Rahmen dessen Datenmanagement, Datenabdeckung und Methoden des Datenanbieters geprüft werden.

CIM kann die ESG-Bewertung des externen Datenanbieters durch eine eigene ESG-Bewertung ergänzen, um etwaige Datenlücken zu schließen.

#### **Sorgfaltspflicht**

Potenzielle Investitionen werden nur dann in die Finanzprodukte aufgenommen, wenn sie den oben zusammengefassten, verbindlichen ESG-Elementen entsprechen, die im Anlageprozess als verbindliche Kriterien implementiert sind. Darüber hinaus führt unser ESG-Anlageteam einen konstanten internen Dialog über Investitionen in Finanzprodukte.

#### **Mitwirkungspolitik**

Mitwirkung ist kein direkter Bestandteil der von den Finanzprodukten beworbenen ökologischen oder sozialen Anlagestrategie. Wir verfügen über keine Verfahren für nachhaltigkeitsbezogene Kontroversen bei Unternehmen, in die wir investieren. Wir interagieren jedoch über die Ausübung unserer Stimmrechtsvertretung mit Unternehmen, in die investiert wird, und können auf diesem Weg bestimmte Nachhaltigkeitsthemen in den Fokus rücken.

#### **Bestimmter Referenzwert**

Für das Finanzprodukt ist kein Referenzwert in Bezug auf die angestrebten ökologischen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

## **Wichtige Informationen**

Bei Citi Private Bank nehmen wir den Schutz Ihrer Daten sehr ernst. Weitere Informationen finden Sie auf unserer Website:  
<https://www.privatebank.citibank.com/privacy>

**Citibank Europe plc, Luxembourg Branch**, eingetragen im Handels- und Gesellschaftsregister von Luxemburg unter der Nummer B 200204, ist eine Niederlassung der Citibank Europe plc. Sie unterliegt der gemeinsamen Aufsicht der Europäischen Zentralbank und der irischen Zentralbank. Sie unterliegt darüber hinaus einer eingeschränkten Regulierung durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier (die CSSF) in ihrer Funktion als Aufsichtsbehörde des Aufnahmemitgliedstaates und ist bei der CSSF unter der Nummer B00000395 registriert. Der Geschäftssitz befindet sich in 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Großherzogtum Luxemburg.

**Citibank Europe plc** wird von der irischen Zentralbank reguliert. Sie ist im Zentralbankregister unter der Referenznummer C26553 eingetragen und wird von der Europäischen Zentralbank beaufsichtigt. Der Geschäftssitz befindet sich in 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irland. Citibank Europe plc ist in Irland unter der Registernummer 132781 eingetragen. Sie wird von der irischen Zentralbank unter der Referenznummer C26553 reguliert.

© 2024 Citigroup Inc Alle Rechte vorbehalten. Citi und Citi mit Bogen sind eingetragene Dienstleistungsmarken von Citigroup oder ihren verbundenen Unternehmen.