

## Citi Equity (US and Global) ESG Focus Portfolios

### Samenvatting van de Informatieverschaffing voor de website

De Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordening met betrekking tot informatieverstrekking over duurzaamheid in de financiële sector ('SFDR')) vereist dat wij een samenvatting geven van de informatie die wij in onze precontractuele informatieverstrekking over een financieel product dat milieu- en/of sociale kenmerken promoot en van bepaalde andere informatie die op een website wordt gepubliceerd. Deze informatieverstrekking wordt voor deze doeleinden gedaan door Citibank Europe plc, met betrekking tot klanten van haar Luxemburgse filiaal in verband met de Citi US Equity ESG Focus Portfolio en de Citi Global Equity ESG Focus Portfolio.

#### **Geen duurzame beleggingsdoelstelling**

Deze financiële producten promoten milieu- of sociale kenmerken, maar hebben duurzame belegging niet als beleggingsdoel.

#### **Ecologische of sociale kenmerken van het financiële product**

De financiële producten promoten de ondersteuning van de principes van het Global Compact van de VN en trachten beleggingen in bepaalde activiteiten die schade kunnen toebrengen aan de gezondheid en het welzijn van de mens te vermijden door bindende uitsluitingen toe te passen.

#### **Beleggingsstrategie**

De volgende bindende ecologische, sociale en corporate governance ('ESG') elementen worden in het beleggingsselectieproces toegepast aan de hand van gegevens van externe ESG-gegevensproviders en/of CIM-beoordeling:

- (i) een positieve ESG-screening wordt toegepast op het beleggingsuniversum om te garanderen dat beleggingen met een gunstige ESG-rating (zoals aangegeven door onze externe ESG-gegevensproviders) worden opgenomen; en
- (ii) de volgende uitsluitingen worden toegepast: (a) ondernemingen die 'niet voldoen' aan de UNGC-principes of die door onze externe ESG-gegevensproviders en/of CIM-beoordeling worden beschouwd als UNGC-schenders; (b) ondernemingen die meer dan 10% omzet (in het voorgaande boekjaar van de onderneming) uit bepaalde activiteiten halen; en (c) ondernemingen die direct of indirect betrokken zijn bij de productie of distributie van controversiële wapens.

Op ad-hocbasis kan CIM de ESG-beoordeling van de externe gegevensprovider aanvullen met zijn eigen beoordeling. Op basis van onze interne fundamentele beoordeling kunnen we posities in de financiële producten opnemen die, op basis van de gegevens van externen, niet lijken te voldoen aan een van de bovenstaande bindende elementen, wanneer we van mening zijn dat de gegevens van externen onvoldoende, onvolledig of onjuist zijn, en op basis van onze eigen fundamentele analyse het bedrijf wel voldoet aan de bovenstaande bindende elementen. We volgen een soortgelijk proces voor uitgevende instellingen die niet worden gedekt door de externe gegevensprovider. Op dezelfde manier kunnen we posities uitsluiten die lijken te voldoen aan een of meer van de bovenstaande criteria, maar waar we het niet eens zijn met de gegevens van externen op basis van onze eigen fundamentele analyse of andere gegevensbronnen.

De praktijken op het gebied van goed bestuur van de ondernemingen waarin is belegd worden ook in aanmerking genomen in het due-diligenceproces voor beleggingen op basis van een rating van externe ESG-gegevens. Raadpleeg de volledige informatieverschaffing van de website voor meer details.

#### **Aandeel van de beleggingen**

De financiële producten verbinden zich tot een minimumaandeel van 80% van de beleggingen om de kenmerken te bereiken die door de financiële producten worden bevorderd. Het resterende deel van de belegging van de financiële producten bestaat uit contanten en equivalenten van contanten, met inbegrip van effecten uitgegeven door gemeenschappelijke geldmarktfondsen, die worden gehouden met het oog op een efficiënt portefeuillebeheer. De financiële producten zijn niet gericht op duurzame beleggingen en houden geen rekening met de EU-Taxonomie; als zodanig is 0% van de financiële producten afgestemd op de Taxonomie. Alle blootstelling aan ondernemingen waarin is belegd zal naar verwachting direct zijn.

#### **Monitoring van ecologische of sociale kenmerken**

De beleggingsstrategieën van de financiële producten worden uitgevoerd via een beleggingsproces dat de ESG-scores van de financiële producten jaarlijks bijwerkt en maandelijks de uitsluitingsgegevens actualiseert waarop wij onze beleggingsbeslissingen baseren. Dit wordt aangevuld door de eigen beoordeling van CIM. Dit garandeert dat de in de financiële producten gebruikte beleggingen zijn afgestemd op de bindende elementen waarmee dit product milieu- of sociale kenmerken promoot.

#### **Methodologieën**

De MSCI US Index (Citi US Equity ESG Focus Portfolio) en de MSCI World Index (Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) worden gebruikt om een basisuniversum voor de relevante financiële producten samen te stellen, waarop een positieve ESG-ratingscreening en uitsluitende ESG-screening worden toegepast op basis van externe ESG-ratings en -gegevens. De ESG-ratings worden door de gegevensprovider bepaald door

rekening te houden met de mate waarin een onderneming is blootgesteld aan materiële ESG-risico's en hoe goed een onderneming haar risicoblootstelling beheert. De datapunten voor de uitsluitende screenings worden door de externe gegevensprovider bepaald aan de hand van de activiteiten van de onderneming. Op ad-hocbasis kan CIM de ESG-beoordeling van de externe gegevensprovider aanvullen met zijn eigen beoordeling. Raadpleeg de volledige informatieverzameling van de website voor meer details.

#### ***Gegevensbronnen en verwerking***

De positieve ESG-screening en de ESG-uitsluitingen worden toegepast aan de hand van ESG-ratings en gegevens van Sustainalytics. De relevante gegevens zijn toegankelijk via de website van de provider of een datafeed die wij maandelijks van de provider ontvangen, en worden gebruikt in het beleggingsproces, waarbij het beleggingsuniversum wordt gedefinieerd, en voor periodieke monitoring (zie hierboven). Aangezien wij voor de milieu- en sociale kenmerken van de financiële producten gebruik maken van gegevens van derden, schatten wij zelf geen gegevens in. We begrijpen dat Sustainalytics een kleine hoeveelheid van de ESG-gegevens die we ontvangen schat vanwege het gebrek aan beschikbare gegevens.

CIM kan ook gebruikmaken van andere openbaar beschikbaar bronnen, evenals onderzoek van externe makelaars en informatie verzameld tijdens bijeenkomsten met het beheer van het bedrijf.

#### ***Beperkingen van methodologieën en gegevens***

Er zijn algemene uitdagingen verbonden aan ESG-gegevens, waarvan we verwachten dat ze ook van toepassing zijn op de gegevens die we van onze gegevensprovider gebruiken - deze omvatten (onder andere) gegevenslacunes, gegevensvertragingen in termen van rapportagetijdlijnen, uiteenlopende methodologieën tussen gegevensproviders en gegevensbronnen voor de berekening of schatting van de gegevens en discrepanties tussen geschatte en gerapporteerde gegevens. Aangezien dit algemene beperkingen in de markt zijn die niet specifiek zijn voor de financiële producten of de door ons geselecteerde gegevensprovider, zijn wij van mening dat wij nog steeds op passende wijze kunnen voldoen aan de kenmerken die door de financiële producten worden bevorderd. We hanteren ook een intern beoordelings- en goedkeuringsproces voor leveranciers, waarbij de benadering van de gegevensprovider inzake gegevensbeheer, gegevensdekking en methodologieën wordt gecontroleerd.

CIM kan de ESG-beoordeling van de externe gegevensprovider aanvullen met zijn eigen beoordeling om eventuele gegevenslacunes te beperken.

#### ***Due Diligence***

Potentiële beleggingen worden alleen in de financiële producten opgenomen als zij voldoen aan de hierboven samengevatte bindende ESG-elementen, die in het beleggingsproces als bindende screenings worden toegepast. Daarnaast voert ons ESG-beleggingsteam voortdurend intern overleg over de beleggingen in de financiële producten.

#### ***Engagementsbeleidlijnen***

Engagement maakt niet rechtstreeks deel uit van de milieu- of sociale beleggingsstrategie die door de financiële producten wordt bevorderd. We hebben geen procedures die van toepassing zijn op duurzaamheidsgerelateerde controverses in ondernemingen waarin is belegd. Wij zijn echter wel betrokken bij ondernemingen waarin is belegd via onze stemvoorkeuren bij volmacht, die kunnen leiden tot stemmingen over onderwerpen die verband houden met bepaalde duurzaamheidskwesties.

#### ***Aangewezen Referentiebenchmark***

De financiële producten hebben geen referentiebenchmark aangewezen om hun milieu- of sociale kenmerken te bereiken.

## **Belangrijke informatie**

Bij Citi Private Bank nemen wij de privacy van uw gegevens serieus. Om meer te weten te komen, kijk op onze website: <https://www.privatebank.citibank.com/privacy>

**Citibank Europe plc, Luxembourg Branch**, geregistreerd bij het Luxembourg Trade and Companies Register onder het nummer B 200204, een filiaal van Citibank Europe plc. Het staat onder gezamenlijk toezicht van de European Central bank en de Central Bank of Ireland. Zij is voorts onderworpen aan een beperkte verordening van door de Commission de Surveillance du Secteur Financier (de CSSF) in haar hoedanigheid van autoriteit van de lidstaat van ontvangst en geregistreerd bij de CSSF onder nummer B00000395. Het zakelijk kantoor is gevestigd op 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Grand Duchy of Luxembourg.

**Citibank Europe plc** staat onder toezicht van de Central Bank of Ireland. Zij staat in het register van de Central Bank met referentienummer C26553 en staat onder toezicht van de European Central Bank. De statutaire zetel te 1 North Wall Quay, Dublin 1, Ireland. Citibank Europe plc is geregistreerd in Ierland met ondernemingsregistratienummer 132781. Zij staat onder toezicht van de Central Bank of Ireland met referentienummer C26553.

© 2024 Citigroup Inc. Alle rechten voorbehouden. Citi en Citi with Arc Design zijn geregistreerde dienstmerken van Citigroup of zijn gelieerde ondernemingen.