

Citi Equity (US and Global) ESG Focus Portfolios

Zusammenfassung der Offenlegung auf der Internetseite

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 US Equity ESG Focus Portfolio und das Citi Global Equity ESG Focus Portfolio.

Kein nachhaltiges Investitionsziel

Diese Finanzprodukte bewerben ökologische oder soziale Merkmale, es werden damit jedoch keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Die Finanzprodukte fördern 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 die folgenden verbindlichen ESG-Elemente angewendet:

- (i) Es wird ein ESG-Positiv-Screening in Bezug auf das Anlageuniversum vorgenommen, um sicherzustellen, dass 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 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 und ziviler Schusswaffen.

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 die Finanzprodukte 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 % der Finanzprodukte taxonomiekonform sind. Es ist davon auszugehen, dass ausschließlich direkte Anlagen in Unternehmen getätigt werden, in die investiert wird.

Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale

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

Methoden für ökologische oder soziale Merkmale

Der MSCI US Index (Citi US Equity ESG Focus Portfolio) und der MSCI World Index (Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) werden verwendet, um ein Basisuniversum der jeweiligen 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. Weitere Informationen finden Sie in der vollständigen Offenlegung auf der Internetseite.

Datenquellen und Datenverarbeitung

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 der Finanzprodukte 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.

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.

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. Durch eine bestimmte Linie in der Ausübung unserer Stimmrechtsvollmachten stehen wir jedoch im Dialog mit Unternehmen, in die investiert wird, da wir damit Nachdruck auf bestimmte nachhaltigkeitsbezogene Themen legen können.

Bestimmter Referenzwert

Für die Finanzprodukte ist kein Referenzwert in Bezug auf die angestrebten ökologischen 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, Niederlassung Luxemburg, eingetragen im Luxemburger Handels- und Gesellschaftsregister 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. Ihr eingetragener Sitz 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.

© 2022 Citigroup Inc. Alle Rechte vorbehalten. Citi und Citi mit Bogen sind eingetragene Dienstleistungsmarken von Citigroup oder ihrer verbundenen Unternehmen.