

# Citi Global Transformation Portfolio

## Zusammenfassung

Die Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor schreibt vor, dass wir die auf einer Website veröffentlichten vorvertraglichen Informationen in Bezug auf ein Finanzprodukt, das ökologische und/oder soziale Merkmale fördert, sowie bestimmte weitere Informationen in zusammengefasster Form bereitstellen. Die Bereitstellung zusammengefasster Informationen zu diesen Zwecken erfolgt durch Citibank Europe plc für Kunden ihrer Luxemburger Niederlassung in Bezug auf das Citi Global Transformation Portfolio

### Kein nachhaltiges Investitionsziel

Diese Finanzprodukte bewerben ökologische und/oder soziale Merkmale, haben jedoch kein nachhaltiges Anlageziel.

### Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Die Finanzprodukte leisten einen positiven Beitrag zur Förderung der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (UN SDGs), indem sie in Unternehmen investieren, die sich in einem oder mehreren von uns ausgewählten und auf die UN SDGs ausgerichteten Nachhaltigkeitsthemen (Citi GTP-Themen) engagieren. Die Finanzprodukte streben darüber hinaus an, die Grundsätze des UN Global Compact (UNGC) zu unterstützen und Investitionen in bestimmte Aktivitäten zu vermeiden, die potenziell die Gesundheit und das Wohlbefinden von Menschen schädigen können, indem sie verbindliche Ausschlüsse anwenden.

### Anlagestrategie

Die folgenden verbindlichen ESG-Elemente werden bei der Auswahl der Anlagen angewendet:

(i) Auf der Grundlage positiver Screenings investieren wir weltweit nur in solche börsennotierten Unternehmen, bei denen im letzten abgeschlossenen Geschäftsjahr mindestens 30 % des Umsatzes auf Aktivitäten in Zusammenhang mit einem oder mehreren der Citi GTP-Themen entfielen. Unternehmen, die diesen Schwellenwert nicht erreichen, von denen wir jedoch ausreichend begründet annehmen, dass sie ihn innerhalb von drei Jahren erreichen werden, können für eine Aufnahme in Betracht gezogen werden. Unternehmen, die auf Grundlage dieses Kriteriums einbezogen werden, können bis zu 20 % des Wertes des Finanzprodukts ausmachen.

(ii) Durch negatives Screening auf der Grundlage von Daten externer Anbieter schließen wir Unternehmen aus, die (a) Einnahmen aus der Produktion, dem Verkauf und/oder dem Transfer von Antipersonenminen oder Streubomben oder aus der Produktion und/oder Herstellung von Tabak erzielen, und (b) gegen den UNGC verstoßen.

Die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, werden auch im Due-Diligence-Prozess für Anlagen berücksichtigt, der auf einem ESG-Datenrating Dritter basiert. Weitere Informationen finden Sie in der vollständigen Offenlegung auf der Internetseite.

### Aufteilung der Investitionen

Die Finanzprodukte verpflichten sich zu einem Mindestanteil von 80 % an Investitionen, die zum Erreichen der von den Finanzprodukten geförderten Ziele beitragen. Der verbleibende Teil der Anlagen der Finanzprodukte kann Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente umfassen, einschließlich von Geldmarktfonds ausgegebener Wertpapiere, die zum Zweck eines effizienten Portfoliomanagements gehalten werden. Die Finanzprodukte beabsichtigen keine nachhaltigen Investitionen und berücksichtigen nicht die EU-Taxonomie, sodass 0 % der Finanzprodukte taxonomiekonform sind. Voraussichtlich wird bei allen Unternehmen, in die investiert wird, ein direktes Engagement erfolgen.

### Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale

Für die Finanzprodukte kommen nur Anlagen infrage, die die oben zusammengefassten verbindlichen ESG-Kriterien erfüllen. Die für die Messung der Umsatzanteile verwendeten Daten werden jährlich aktualisiert, die Daten für die Ausschlüsse vierteljährlich.

### Methoden für ökologische oder soziale Merkmale

Das Anlageuniversum der Finanzprodukte wird zunächst durch positive Screenings eingegrenzt, um weltweit börsennotierte Unternehmen einzubeziehen, bei denen im letzten abgeschlossenen Geschäftsjahr mindestens 30 % des Umsatzes auf Aktivitäten in Zusammenhang mit einem oder mehreren der Citi GTP-Themen entfielen. Unternehmen, die diesen Schwellenwert nicht erreichen, von denen wir jedoch ausreichend begründet annehmen, dass sie ihn innerhalb von drei Jahren erreichen werden, können für eine Aufnahme in Betracht gezogen werden. Unternehmen, die auf Grundlage dieses Kriteriums einbezogen werden, können bis zu 20 % der Finanzprodukte ausmachen.

Die weitere Definition des Anlageuniversums erfolgt durch negative Screenings auf der Grundlage von Daten, die durch externe Anbieter bereitgestellt werden. Im Einklang mit dem UNGC schließen wir Unternehmen aus, die Umsätze aus der Herstellung, dem Verkauf und/oder der Weitergabe von Antipersonenminen oder Streubomben oder aus der Produktion und/oder Herstellung von Tabak erzielen.

Ebenfalls durch negative Screenings werden Unternehmen ausgeschlossen, die gegen den UNGC verstoßen. Die von Drittanbietern von Daten angewandten Methoden sind subjektiv und werden von uns möglicherweise als unvollständig oder mangelhaft beurteilt. Wir berücksichtigen und prüfen bestimmte Unternehmen, die wir selbst als konform mit dem UN Global Compact einstufen, obwohl sich aus der subjektiven Bewertung von Drittanbietern keine solche Konformität ergibt. Solche Unternehmen können für Investitionen in Betracht gezogen werden. Ausnahmen nach diesem Kriterium können bis zu 20 % des Portfolios ausmachen. Weitere Informationen finden Sie in der vollständigen Offenlegung auf der Internetseite.

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

Der auf Citi GTP-Themen entfallende Umsatz wird anhand direkter Offenlegungen von börsennotierten Unternehmen bewertet. Die entsprechenden Daten werden direkt von den Unternehmen oder über Bloomberg und/oder FactSet bezogen. Da dies öffentlich bekannt gegebene Unternehmensdaten sind, gehen wir nicht davon aus, dass es sich dabei um Schätzungen handeln kann. Die Ausschlüsse werden anhand von Daten angewendet, die von Sustainalytics bereitgestellt werden. Der Zugriff auf die relevanten Daten erfolgt monatlich über die Plattform des Anbieters bzw. über einen Datenfeed des Anbieters. Die Verwendung der Daten erfolgt bei den ersten Schritten des Anlageprozesses, in dem das Anlageuniversum definiert wird, sowie zum Zweck der regelmäßigen Kontrolle (s.o.). Uns ist bekannt, dass Sustainalytics geschätzte ESG-Daten an uns übermitteln kann, wenn die entsprechenden Daten nicht vorliegen.

#### **Beschränkungen hinsichtlich der Methoden und Daten**

Allgemein bestehen bestimmte Probleme und Mängel im Zusammenhang mit ESG-Daten. Wir gehen davon aus, dass dies auch die Daten betrifft, die wir von unseren Datenanbietern und vom Markt erhalten. Zu diesen Problemen und Mängeln gehören unter anderem Datenlücken, Verzögerungen bei der Übermittlung von Daten, je nach Datenanbieter und Datenquelle unterschiedliche Methoden für die Berechnung oder Schätzung von Daten sowie Abweichungen zwischen geschätzten und tatsächlich gemeldeten Daten. Da es sich hierbei um allgemeine Probleme handelt, die nicht ausschließlich die Finanzprodukte oder unsere ausgewählten Datenanbieter betreffen, sind wir der Ansicht, dass wir die von den Finanzprodukten beworbenen Merkmale dennoch angemessen erfüllen können. Mit einem internen Prüf- und Genehmigungsverfahren für Datenanbieter beurteilen wir darüber hinaus deren Arbeitsweise in Bezug auf Datenmanagement, Datenabdeckung und Methoden.

#### **Sorgfaltspflicht**

Potenzielle Anlagen werden nur dann in die Finanzprodukte einbezogen, wenn sie den oben zusammengefassten, verbindlichen ESG-Kriterien entsprechen, deren Prüfung verbindliches Element des Anlageprozess ist. Darüber hinaus führt unser ESG-Anlageteam einen konstanten internen Dialog über Investitionen in Finanzprodukte.

#### **Mitwirkungspolitik**

Mitwirkung ist kein direkter Bestandteil der von den Finanzprodukten geförderten 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 die Finanzprodukte ist kein Referenzwert in Bezug auf die angestrebten ökologischen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

## **Wichtige Informationen**

Bei Citi Private Bank hat der Schutz Ihrer Daten hohe Priorität. Weitere Informationen dazu finden Sie auf unserer Website:

<https://www.privatebank.citibank.com/privacy>

**Citibank Europe plc, Niederlassung Luxemburg**, 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 (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 Zentralbank-Register 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.

© 2023 Citigroup Inc Alle Rechte vorbehalten. Citi und Citi mit Bogen sind eingetragene Dienstleistungsmarken von Citigroup oder ihren verbundenen Unternehmen.