

# Citi Equity (US and Global) ESG Focus Portfolios

## Oversigt over oplysninger på websted

Forordningen om bæredygtighedsrelaterede oplysninger i sektoren for finansielle tjenesteydelser (SFDR) kræver, at vi giver en oversigt over oplysninger givet forud for indgåelse af en aftale i forbindelse med et finansielt produkt, som fremmer miljømæssige og/eller sociale karakteristika, samt over andre oplysninger, der er offentliggjort på et websted. Disse oplysninger offentliggøres med disse formål af Citibank Europe plc i relation til klienter i Luxembourg-filialen i forbindelse med Citi US Equity ESG Focus Portfolio og Citi Global Equity ESG Focus Portfolio

### **Intet bæredygtigt investeringsmål**

Disse finansielle produkter fremmer miljømæssige eller sociale karakteristika, men de har ikke som målsætning at investere bæredygtigt.

### **Miljømæssige eller sociale karakteristika ved det finansielle produkt**

De finansielle produkter fremmer støtte af FN's Global Compact-principper (UNGC) og søger at undgå investeringer i visse aktiviteter, som potentielt kan skade menneskers helbred og velbefindende, ved at anvende bindende udelukkelse.

### **Investeringsstrategi**

Følgende bindende miljømæssige, sociale og ledelsesmæssige elementer (ESG) anvendes i processen for investeringsudvælgelse ved hjælp af data fra tredjepartsudbydere af ESG-data:

- (i) Der anvendes en positiv ESG-screening af investeringsuniverset for at sikre, at investeringer udviser fordelagtige ESG-vurderinger (som defineret af vores tredjepartsudbydere af ESG-data), og
- (ii) Følgende udelukkelse anvendes: (a) virksomheder, der ikke overholder UNGC-principperne anses for UNGC-overtrædere af vores tredjepartsudbydere af ESG-data, (b) virksomheder, der får mere end 10 % af deres indtjening (i virksomhedens foregående regnskabsår) fra visse aktiviteter, og (c) virksomheder med direkte eller indirekte tilknytning til produktion eller distribution af kontroversielle våben og civile skydevåben.

Der tages i due diligence-processen for investeringer desuden hensyn til god ledelsespraksis i investeringsmodtagende virksomheder baseret på en tredjepartsvurdering af ESG-data. Du kan finde yderligere detaljer i de samlede webstedsoplysninger.

### **Investeringsandele**

De finansielle produkter forpligtes til, at mindst 80 % af investeringerne skal opnå de karakteristika, som fremmes af de finansielle produkter. Den resterende del af investeringen i de finansielle produkter består af kontanter og likvide midler, herunder værdipapirer udstedt af pengemarkedsforeninger, som ejes med henblik på effektiv porteføljeforvaltning. De finansielle produkter har ikke til hensigt at foretage nogen bæredygtige investeringer og tager ikke hensyn til EU-taksonomien, og således er 0 % af de finansielle produkter i overensstemmelse med taksonomien. Al eksponering for investeringsmodtagende virksomheder forventes at være direkte.

### **Overvågning af miljømæssige eller sociale karakteristika**

De finansielle produkters investeringsstrategier implementeres gennem en investeringsproces, der opdaterer de finansielle produkters ESG-score årligt, og som hver måned opdaterer de udelukkelsesdata, som vi træffer vores investeringsbeslutninger på baggrund af. Dette sikrer, at de investeringer, der anvendes i de finansielle produkter, bringes i overensstemmelse med de bindende elementer, der anvendes af dette produkt til at fremme miljømæssige eller sociale karakteristika.

### **Metoder for miljømæssige eller sociale karakteristika**

MSCI US Index (Citi US Equity ESG Focus Portfolio) og MSCI World Index (Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) anvendes til at etablere et basisunivers for de relevante finansielle produkter, som underlægges en positiv ESG-vurderingsscreening og ESG-udelukkelse screening baseret på ESG-vurderinger og -data fra tredjeparter. ESG-vurderingerne bestemmes af dataudbyderen under hensyntagen til, i hvilket omfang en virksomhed er eksponeret for væsentlige ESG-risici, og hvor godt en virksomhed håndterer sin risikoeksponering. Datapunkterne for udelukkelse screeningerne bestemmes af tredjepartsudbyderen af data under hensyntagen til virksomhedens aktiviteter. Du kan finde yderligere detaljer i de samlede webstedsoplysninger.

### **Datakilder og -behandling**

Den positive ESG-screening og ESG-udelukkelse anvendes ved brug af ESG-vurderinger og -data fra Sustainalytics. De relevante data er tilgængelige via udbyderens websted eller et datafeed, som vi modtager fra udbyderen hver måned, og som bruges i investeringsprocessen, hvor investeringsuniverset er defineret og under periodisk overvågning (se ovenfor). Da vi anvender tredjepartsdata til at opfylde de finansielle produkters miljømæssige og sociale karakteristika, vurderer vi ikke selv nogen data. Vi forstår, at Sustainalytics estimerer en lille mængde af de ESG-data, vi modtager på grund af manglen på tilgængelige data.

### **Begrænsninger i forbindelse med metoder og data**

Der er generelle udfordringer forbundet med ESG-data, som vi forventer også gælder for de data, vi udnytter fra vores dataudbydere. Disse omfatter (blandt andet) datahuller, dataforsinkelser i forhold til tidslinjer for rapportering, divergerende metoder mellem dataudbydere og datakilder til beregning eller estimering af data og uoverensstemmelser mellem anslåede og rapporterede data. Da dette er generelle begrænsninger på markedet, som ikke er specifikke for de finansielle produkter eller vores udvalgte dataudbydere, mener vi, at vi stadig er i stand til på passende vis at opfylde de karakteristika, som de finansielle produkter fremmer. Vi har også en intern proces for leverandørgennemgang og -godkendelse, som omfatter gennemgang af dataudbyderens tilgang til datahåndtering, datadækning og metoder.

### **Due diligence**

Potentielle investeringer vil kun blive inkluderet i de finansielle produkter, hvis de overholder de bindende miljømæssige, sociale og ledelsesmæssige elementer (ESG), der er opsummeret ovenfor, og som er implementeret i investeringsprocessen som bindende screeninger. Derudover deltager vores ESG-dedikerede investeringsteam i løbende interne diskussioner om investeringer i finansielle produkter.

### **Engagementspolitikker**

Engagement er ikke direkte en del af den miljømæssige eller sociale investeringsstrategi, der fremmes af de finansielle produkter. Vi har ingen procedurer, der gælder for bæredygtighedsrelaterede kontroverser i investeringsmodtagende virksomheder. Vi engagerer os dog i investeringsmodtagende virksomheder via vores præferencer for fuldmagtsafstemning, som kan dirigere stemmer til emner, der er tilpasset visse bæredygtighedsspørgsmål.

### **Angivet referencebenchmark**

De finansielle produkter har ikke angivet et referencebenchmark med henblik på at opnå de miljømæssige eller sociale karakteristika.

## Vigtige oplysninger

Hos Citi Private Bank tager vi beskyttelse af dine personlige oplysninger alvorligt. Du kan få mere at vide på vores websted:

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

**Citibank Europe plc, Luxembourg Branch**, registreret hos Luxembourg Trade and Companies Register under nummer B 200204, er en filial af Citibank Europe plc. Den er underlagt den Europæiske Centralbanks og den Irske Centralbanks fælles tilsyn. Den er desuden underlagt begrænset regulering fra Commission de Surveillance du Secateur Financier (CSSF), som er værtslandets myndighed, og registreret hos CSSF under nummer B00000395. Den er beliggende på 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Storhertugdømmet Luxembourg.

**Citibank Europe plc** er reguleret af den Irske Centralbank. Den fremgår af centralbankens register med referencenummeret C26553 og overvåges af den Europæiske Centralbank. Dens hjemsted er 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irland. Citibank Europe plc er registreret i Irland med virksomhedsregistreringsnummer 132781. Den reguleres af den Irske Centralbank under referencenummeret C26553.

© 2022 Citigroup Inc. Alle rettigheder forbeholdes. Citi og Citi with Arc Design er registrerede servicemærker tilhørende Citigroup eller deres associerede selskaber.