

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

Shrnutí zveřejněných informací uvedených na webových stránkách

Nařízení o zveřejňování informací o udržitelném financování („SFDR“) vyžaduje, abychom shrnuli informace uvedené v předmluvních informacích o finančním produktu, který prosazuje environmentální a/nebo sociální vlastnosti, a některé další informace zveřejněné na internetových stránkách. Toto prohlášení pro tyto účely provádí společnost Citibank Europe plc ve vztahu ke klientům své lucemburské pobočky v souvislosti s fondy Citi US Equity ESG Focus Portfolio a Citi Global Equity ESG Focus Portfolio.

### **Žádný cíl udržitelných investic**

Tyto finanční produkty prosazují environmentální nebo sociální vlastnosti, ale jejich investičním cílem není udržitelné investování.

### **Environmentální nebo sociální vlastnosti finančního produktu**

Finanční produkty podporují zásady UN Global Compact (UNGC) a snaží se vyhnout investicím do určitých činností, které by mohly způsobit škody na lidském zdraví a blahu, uplatňováním závazných výjimek.

### **Investiční strategie**

Následující závazné prvky ESG (životní prostředí, sociální věci a správní oblast) platí v procesu výběru investic pomocí údajů od poskytovatelů údajů ESG třetích stran a/nebo hodnocení CIM:

- (i) na soubor investic se aplikuje pozitivní kontrola ESG s cílem zajistit, aby investice vykazovaly příznivé hodnocení ESG (dle ukazatelů našich externích poskytovatelů údajů o ESG); a
- (ii) platí následující výjimky: (a) společnosti, které „nedodrží“ zásady UNGC nebo jsou našimi externími poskytovateli údajů o ESG a/nebo hodnocení CIM považovány za společnosti porušující zásady UNGC; (b) společnosti, které mají více než 10 % příjmů (v předchozím fiskálním roce společnosti) z určitých činností; a (c) společnosti, které jsou přímo nebo nepřímo spojeny s výrobou nebo distribucí kontroverzních zbraní.

CIM může ad-hoc doplnit údaje třetích stran týkající se hodnocení ESG svými vlastními. Budeme-li se domnívat, že jsou údaje třetích stran nedostatečné, neúplné nebo nepřesné, a dospějeme-li na základě vlastní fundamentální analýzy k závěru, že společnost je s výše uvedenými závaznými prvky v souladu, pak je možné zahrnout i pozice ve finančních produktech, o kterých se dle údajů třetích stran zdá, že v některých z výše uvedených závazných prvků selhávají. Podobného postupu se držíme i u emitentů, o kterých nemáme údaje třetí strany. Pokud s údaji třetích stran nebudeme souhlasit, protože se rozcházejí s údaji naší vlastní fundamentální analýzy, je stejně tak možné vyloučit pozice, o nichž se zdá, že jedno nebo více z výše uvedených kritérií splňují.

Postupy řádné správy a řízení společností, do nichž bylo investováno, jsou rovněž zohledněny v procesu kontroly investic na základě hodnocení údajů ESG třetí stranou. Pro podrobnější informace viz úplná verze prohlášení na webových stránkách.

### **Poměr investic**

Finanční produkty se zavazují k minimálnímu podílu 80 % investic pro dosažení vlastností, které finanční produkty podporují. Zbývající část investic finančních produktů je složená z hotovosti a peněžních ekvivalentů, včetně cenných papírů vydaných podílovými fondy peněžního trhu, držných za účelem efektivní správy portfolia. Finanční produkty nemají za cíl provádět žádné udržitelné investice a nezohledňují taxonomii EU, proto je 0 % finančních produktů v souladu s taxonomií. Předpokládá se, že veškerá expozice vůči společnostem, do nichž je investováno, bude přímá.

### **Sledování environmentálních nebo sociálních vlastností**

Investiční strategie finančních produktů se provádí prostřednictvím investičního procesu, který každoročně aktualizuje hodnocení ESG finančních produktů a každý měsíc aktualizuje údaje o výlukách, na jejichž základě přijímáme investiční rozhodnutí. To je doplněno vlastním hodnocením CIM. Tím se zajišťuje, že investice používané ve finančních produktech jsou v souladu se závaznými prvky, které tento produkt používá k podpoře environmentálních nebo sociálních vlastností.

### **Metodiky**

Index MSCI US (Citi US Equity ESG Focus Portfolio) a index MSCI World (Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) se používají k vytvoření základního souboru příslušných finančních produktů, na které se na základě hodnocení a údajů třetích stran o ESG aplikuje pozitivní rating ESG a vylučovací kritéria ESG. Ratingy ESG určuje poskytovatel údajů s ohledem na to, do jaké míry je společnost vystavena významným rizikům ESG a jak dobře si společnost vede při řízení vystavení rizikům. Údaje pro vylučovací kritéria určuje poskytovatel údajů třetí strany s ohledem na činnosti společnosti. CIM může ad-hoc doplnit údaje třetích stran týkající se hodnocení ESG svými vlastními. Pro podrobnější informace viz úplná verze prohlášení na webových stránkách.

### **Zdroje a zpracování údajů**

Positivní hodnocení ESG a vyloučení ESG se aplikují na základě hodnocení ESG a údajů poskytnutých společnostmi Sustainalytics. Příslušné údaje jsou přístupné přes webové stránky poskytovatele nebo přes datový kanál, který od něj každý měsíc dostáváme, a využívají se v investičním procesu, kde se definuje soubor investic, a k pravidelnému monitoringu (viz výše). Vzhledem k tomu, že pro splnění environmentálních a sociálních vlastností finančních produktů využíváme údaje třetích stran, sami žádné údaje neposuzujeme. Chápeme, že společnost Sustainalytics posuzuje malé množství údajů ESG, které dostáváme, a to kvůli nedostatku dostupných údajů.

CIM může také využívat jiné veřejně dostupné zdroje nebo závěry výzkumu a informace od externího makléře shromážděné při setkání s vedením společnosti.

#### **Omezení metodik a údajů**

S údaji ESG jsou spojeny obecné problémy, jež se podle našeho očekávání týkají i údajů, které využíváme od našeho poskytovatele - patří k nim (mimo jiné) mezery v údajích, zpoždění údajů z hlediska lhůt pro jejich vykazování, rozdílné metodiky poskytovatelů údajů a zdrojů údajů pro výpočet nebo odhad údajů a nesrovnalosti mezi odhadovanými a vykazovanými údaji. Vzhledem k tomu, že se jedná o obecná omezení na trhu, která nejsou specifická pro finanční produkty ani námi zvoleného poskytovatele údajů, domníváme se, že jsme stále schopni vhodně naplnit vlastnosti prosazované finančními produkty. Udržujeme také interní proces kontroly a schvalování dodavatelů, který zahrnuje přezkoumání přístupu poskytovatele údajů ke správě údajů, pokrytí údajů a metodiky.

Za účelem zaplnění případných mezer v údajích může CIM údaje třetích stran týkající se hodnocení ESG doplnit svými vlastními.

#### **Kontrola**

Potenciální investice budou do finančních produktů zařazeny pouze v případě, že splní výše shrnuté závazné prvky ESG, které jsou obsažené v investičním procesu jako závazná kritéria. Naš investiční tým specializovaný na ESG se navíc průběžně zapojuje do interních diskusí týkajících se investic do finančních produktů.

#### **Zásady zapojení**

Zapojení není přímou součástí environmentální ani sociální investiční strategie podporované finančními produkty. Nemáme žádné postupy, které by se vztahovaly na kontroverze související s udržitelností ve společnostech, do nichž je investováno. Do společností, do nichž investujeme, jsme zapojení přes naše preference pro hlasování v zastoupení. Ty mohou směřovat hlasování k otázkám souvisejícím s některými otázkami udržitelnosti.

#### **Stanovená referenční hodnota**

Finanční produkty nemají stanovenou referenční hodnotu pro účely dosažení svých environmentálních nebo sociálních vlastností.

## **Důležité informace**

V Citi Private Bank bereme ochranu vašich osobních údajů vážně. Podrobnější informace naleznete na naší webové stránce:

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

**Citibank Europe plc, lucemburská pobočka**, zapsaná v lucemburském obchodním rejstříku pod číslem B 200204, je pobočkou společnosti Citibank Europe plc. Podléhá společnému dohledu Evropské centrální banky a Central Bank of Ireland. Dále podléhá omezené regulaci ze strany Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) jako orgánu hostitelského členského státu a je registrována u CSSF pod číslem B00000395. Její obchodní kancelář se nachází na adrese 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Lucemburské velkovévodství.

**Citibank Europe plc** je regulována Central Bank of Ireland. Je zapsána v registru centrální banky pod referenčním číslem C26553 a podléhá dohledu Evropské centrální banky. Registrované sídlo má na adrese 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irsko. Citibank Europe plc je registrována v Irsku pod registračním číslem 132781. Spadá pod dohled Centrální banky pod referenčním číslem C26553.

© 2024 Citigroup Inc. Všechna práva vyhrazena. Citi a Citi with Arc Design jsou registrované značky služeb společností Citigroup nebo jejich přidružených společností.