

19 juillet 2024

# Citi Global Equity ESG Focus Portfolio

## Résumé de la publication d'informations sur le site Internet

Le Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (Règlement SFDR) exige que nous résumions les informations fournies dans nos informations précontractuelles publiées concernant un produit financier qui promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales, ainsi que certaines autres informations publiées sur un site Internet. La présente publication d'informations est faite à ces fins par Citibank Europe plc concernant les clients de sa succursale luxembourgeoise vis-à-vis du Citi Global Equity ESG Focus Portfolio.

### ***Aucun objectif d'investissement durable***

Ce produit financier promeut des caractéristiques environnementales ou sociales, mais l'investissement durable n'est pas son objectif d'investissement.

### ***Caractéristiques environnementales ou sociales du produit financier***

Le produit financier promeut le soutien aux principes du Pacte mondial des Nations Unies et cherchent à éviter les investissements dans certaines activités susceptibles de nuire à la santé et au bien-être humains en appliquant des exclusions contraignantes.

### ***Stratégie d'investissement***

Les éléments environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) contraignants ci-après sont appliqués dans le processus de sélection des investissements à l'aide de données provenant du fournisseur de données ESG tiers et/ou de l'évaluation CIM :

- (i) un filtre ESG positif est appliquée à l'univers d'investissement pour s'assurer que les investissements dans des titres présentent des notations ESG favorables (telles qu'indiquées par notre fournisseur de données ESG tiers) ; et
- (ii) que les exclusions suivantes s'appliquent : (a) les sociétés qui ne sont pas « conformes » aux principes du Pacte mondial des Nations Unies ou qui sont considérées comme des contrevenants au Pacte mondial des Nations Unies par notre fournisseur de données ESG tiers et/ou l'évaluation CIM ; (b) les sociétés qui génèrent plus de 10 % de revenus (au cours de l'exercice fiscal précédent de la société) de certaines activités ; et (c) les sociétés associées directement ou indirectement à la fabrication ou la distribution d'armes controversées.

Sur une base ad hoc, CIM peut compléter l'évaluation ESG des fournisseurs de données tiers par sa propre évaluation. Sur la base de notre analyse fondamentale interne, nous pouvons inclure des positions dans les produits financiers qui, sur la base des données de tiers, semblent manquer à l'une des exigences ci-dessus, lorsque nous estimons que les données de tiers sont insuffisantes, incomplètes ou inexactes, et si, sur la base de notre propre analyse fondamentale, la société est conforme auxdites exigences. Nous suivons un processus similaire pour les émetteurs qui ne sont pas couverts par le fournisseur de données tiers. De même, nous pouvons exclure des positions qui semblent répondre à un ou plusieurs des critères ci-dessus lorsque nous ne sommes pas d'accord avec les données de tiers sur la base de notre propre analyse fondamentale ou d'autres sources de données.

Les bonnes pratiques de gouvernance des sociétés bénéficiaires des investissements sont également prises en compte dans le processus de diligence raisonnable des investissements reposant sur une notation de données ESG réalisée par un fournisseur tiers. Veuillez consulter l'intégralité de la publication d'informations sur le site Internet pour en savoir plus.

### ***Proportion des investissements***

Le produit financier s'engage à atteindre une proportion minimale de 80 % des investissements pour atteindre les caractéristiques promues par ceux-ci. La part restante des investissements des produits financiers est constituée de liquidités et d'équivalents de liquidités, y compris de titres émis par des fonds communs de placement monétaires, détenus à des fins de gestion efficace de portefeuille. Le produit financier n'a pas pour objectif de réaliser des investissements durables et ne tient pas compte du Règlement européen sur la taxonomie et, à ce titre, aucun des produits financiers n'est aligné sur ledit règlement. Toute exposition aux sociétés bénéficiaires des investissements devrait être directe.

### ***Suivi des caractéristiques environnementales ou sociales***

La stratégie d'investissement du produit financier est mise en œuvre par le biais d'un processus d'investissement qui actualise les scores ESG du produit financier chaque année et, sur une base mensuelle, met à jour les données d'exclusion en fonction desquelles nous prenons nos décisions d'investissement. Ceci est complété par l'évaluation propre de CIM. Cela garantit l'alignement des investissements des produits financiers sur les éléments contraignants utilisés par ces produits afin de promouvoir des caractéristiques environnementales ou sociales.

### ***Méthodes***

L' indice MSCI World Index est utilisé dans le but d'établir un univers de base pour le produit financier, auquel un filtre de notation ESG positif et des filtres ESG exclusifs sont appliqués en fonction des notations et des données ESG de fournisseurs tiers. Les notations ESG sont définies par le fournisseur de données en tenant compte de la mesure dans laquelle une société est exposée à des risques ESG importants et de la façon dont une société gère son exposition au risque. Les points de données des filtres d'exclusion sont définis par le fournisseur de données tiers en tenant compte des activités de l'entreprise. Sur une base *ad hoc*, CIM peut compléter l'évaluation ESG des fournisseurs de données tiers par sa propre évaluation. Veuillez consulter l'intégralité de la publication d'informations sur le site Internet pour en savoir plus.

#### **Sources et traitement des données**

Le filtre ESG positif et les exclusions ESG sont appliqués en utilisant les notations et données ESG fournies par Sustainalytics. Les données pertinentes sont accessibles par le site Internet du fournisseur ou via une source de données que nous recevons chaque mois du fournisseur et utilisées dans le processus d'investissement, où l'univers d'investissement est défini, et à des fins de suivi périodique (voir ci-dessus). Dans la mesure où nous exploitons les données de tiers pour satisfaire aux caractéristiques environnementales et sociales du produit financier, nous ne procérons à aucune estimation de données nous-mêmes. Nous comprenons que Sustainalytics procède à une estimation d'une petite quantité de données ESG que nous recevons en raison du manque de données disponibles.

CIM peut également utiliser d'autres ressources publiques, ainsi que les recherches et les informations de courtiers externes recueillies lors de réunions avec la direction de la société.

#### **Limites des méthodologies et des données**

Des défis d'ordre général sont associés aux données ESG et, selon nous, s'appliquent également aux données que nous exploitons de notre fournisseur de données. Il s'agit notamment des écarts de données, des retards de données sur le calendrier de reporting, des divergences de méthodologies entre les fournisseurs de données et les sources de données pour le calcul ou l'estimation des données et des écarts entre les données estimées et celles déclarées. Dans la mesure où il s'agit de limites générales du marché qui ne sont pas spécifiques aux produits financiers ou au fournisseur de données que nous avons sélectionné, nous considérons que nous sommes toujours en mesure de répondre de manière appropriée aux caractéristiques promues par les produits financiers. Nous maintenons également un processus interne d'examen et d'approbation des fournisseurs qui implique de revoir l'approche du fournisseur de données en matière de gestion des données, de couverture des données et de méthodologies.

CIM peut compléter l'évaluation ESG du fournisseur de données tiers par la sienne afin d'atténuer tout écart de données.

#### **Diligence raisonnable**

Les investissements potentiels seront inclus dans les produits financiers uniquement s'ils sont conformes aux éléments ESG contraignants résumés ci-dessus, lesquels sont mis en œuvre dans le processus d'investissement en tant que filtres contraignants. En outre, notre équipe d'investissement dédiée aux facteurs ESG participe à des discussions internes continues portant sur les investissements dans les produits financiers.

#### **Politiques d'engagement**

L'engagement ne fait pas directement partie de la stratégie d'investissement environnementale ou sociale promue par les produits financiers. Nous n'avons pas de procédures applicables aux controverses liées à la durabilité des sociétés bénéficiaires des investissements. Toutefois, nous nous engageons auprès des sociétés bénéficiaires des investissements par le biais de nos préférences de vote par procuration, qui peuvent orienter les votes vers des questions liées à certaines questions de durabilité.

#### **Indice de référence désigné**

Il n'a pas été désigné d'indice de référence pour le produit financier en vue de satisfaire à ses caractéristiques environnementale ou sociale.

## **Informations importantes**

Chez Citi Private Bank, nous prenons la confidentialité de vos données au sérieux. Pour en savoir plus, rendez-vous sur notre site Web : <https://www.privatebank.citibank.com/privacy>

**Citibank Europe plc, succursale de Luxembourg**, immatriculée au Registre du Commerce et des sociétés de Luxembourg sous le numéro B 200204, est une succursale de Citibank Europe plc. Elle est soumise à la supervision conjointe de la Banque centrale européenne et de la Banque centrale d'Irlande. Elle est par ailleurs soumise à une réglementation limitée de la Commission de surveillance du secteur financier (la CSSF) dans le cadre de ses fonctions d'autorité d'un État membre d'accueil et enregistrée auprès de la CSSF sous le numéro B00000395. Son bureau est sis 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Grand-Duché de Luxembourg.

**Citibank Europe plc** est réglementée par la Banque centrale d'Irlande. Elle apparaît sur le registre de la Banque centrale sous le numéro de référence C26553 et est supervisée par la Banque centrale européenne. Son siège social est sis 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irlande. Citibank Europe plc est enregistrée en Irlande sous le numéro de registre 132781. Elle est réglementée par la Banque centrale d'Irlande sous le numéro de référence C26553.

© 2024 Citigroup Inc. Tous droits réservés. Citi et Citi with Arc Design sont des marques de service déposées de Citigroup ou de ses sociétés affiliées.