

Citi Global Equity ESG Focus Portfolio

A weboldali közzététel összefoglalója

A fenntarthatósággal kapcsolatos közzétételekről szóló rendelet (az „SFDR”) előírja, hogy a szerződéskötés előtti tájékoztatónkban összefoglaljuk a környezeti és/vagy társadalmi jellemzőket elősegítő pénzügyi termékekre vonatkozó információkat, valamint bizonyos egyéb, a weboldalon közzétett információkat. Ezt a közzétételt a Citibank Europe plc a luxemburgi fióktelepének ügyfelei vonatkozásában, a Citi Global Equity ESG Focus Portfolio kapcsán erre a célra készítette.

Nincs fenntartható befektetési célkitűzés

Ez a pénzügyi termék előmozdítja a környezeti vagy társadalmi jellemzők érvényesülését, de nem rendelkezik fenntartható befektetési célkitűzéssel.

A pénzügyi termék környezeti vagy társadalmi jellemzői

A pénzügyi termék előmozdítja az ENSZ Globális Megállapodásának (UNGC) alapelveit, és kötelező érvényű kizárások alkalmazásával igyekeznék elkerülni bizonyos tevékenységekbe történő befektetéseket, amelyek potenciálisan károsíthatják az emberi egészséget és jólétet.

Befektetési stratégia

A befektetés kiválasztási folyamatában a következő kötelező környezeti, társadalmi és vállalatirányítási („ESG”) elemeket alkalmazzuk, harmadik fél ESG-adatszolgáltató adatainak felhasználásával és/vagy a CIM értékelésével:

- (i) pozitív ESG-szűrőt alkalmazunk a befektetési univerzumhoz annak biztosítására, hogy a befektetések kedvező ESG-besorolást kapjanak (a harmadik fél ESG-adatszolgáltatónk által meghatározottak szerint); és
- (ii) a következő kizárásokat alkalmazzuk: (a) olyan vállalatok, amelyek „nem felelnek meg” az UNGC alapelveinek, vagy harmadik fél ESG-adatszolgáltatónk és/vagy a CIM értékelése szerint megsértik az UNGC alapelveit; (b) olyan vállalatok, amelyek bizonyos tevékenységekből (a vállalat előző pénzügyi évében) több mint 10%-os bevétellel rendelkeznek; és (c) olyan vállalatok, amelyek közvetlen vagy közvetett kapcsolatban állnak különösen nagy kárt okozó fegyverek gyártásával vagy terjesztésével.

A CIM eseti jelleggel kiegészítheti a harmadik fél adatszolgáltató ESG-értékelését a sajátjával. Belső fundamentális felülvizsgálatunk alapján felvehetünk olyan pozíciókat a pénzügyi termékben, amelyek a harmadik féltől származó adatok alapján látszólag nem felelnek meg a fenti kötelező elemek bármelyikének, amennyiben úgy véljük, hogy a harmadik féltől származó adatok elégtelenek, hiányosak vagy pontatlanok, és a saját fundamentális elemzésünk alapján a vállalat megfelel a fenti kötelező elemeknek. Hasonló eljárást követünk azon kibocsátók esetében, amelyeket nem fed le a harmadik fél adatszolgáltató. Hasonlóképpen kizárhatunk olyan pozíciókat, amelyek látszólag megfelelnek a fenti kritériumok közül egy vagy több feltételnek, de amelyek esetében a saját fundamentális elemzésünk vagy más adatforrások alapján nem értünk egyet a harmadik féltől származó adatokkal.

A befektetést fogadó vállalkozások jó irányítási gyakorlatát a befektetés átvilágítási folyamatának során is figyelembe vesszük, harmadik fél ESG-adatminősítése alapján. További részletekért tekintse meg a teljes weboldali közzétételt.

A befektetések aránya

A pénzügyi termék által támogatott jellemzők elérése érdekében a pénzügyi termék a befektetések minimum 80%-át teszi ki. A pénzügyi termék befektetésének fennmaradó részét a hatékony portfóliókezelés érdekében tartott pénzeszközök és pénzeszközökkel egyenértékű eszközök teszik ki, beleértve a pénzpiaci befektetési alapok által kibocsátott értékpapírokat. A pénzügyi termék nem szándékozik fenntartható befektetéseket megvalósítani, és nem veszik figyelembe az uniós taxonómiai rendeletet, így a pénzügyi termék 0%-a áll összhangban a taxonómiai rendelettel. A befektetést fogadó vállalkozásokkal szembeni összes kitettséggel várhatóan közvetlen lesz.

Környezeti vagy társadalmi jellemzők monitorozása

A pénzügyi termék befektetési stratégiája egy befektetési folyamaton keresztül valósul meg, amely évente frissíti a pénzügyi termék ESG-pontszámait, és havonta frissíti azokat a kizárásra vonatkozó adatokat, amelyek alapján befektetési döntéseinket meghozzuk. Ez kiegészül a CIM saját értékelésével. Ez biztosítja, hogy a pénzügyi termékekben alkalmazott befektetések összhangban legyenek a termék által a környezeti vagy társadalmi jellemzők előmozdítására használt kötelező elemekkel.

Módszertanok

A pénzügyi termék alapuniverzumának létrehozására az MSCI World Index szolgál, amelyre pozitív ESG-minősítési szűrőt és kizárásos ESG-szűrőket alkalmazunk harmadik felek ESG-minősítései és adatai alapján. Az ESG-minősítéseket az adatszolgáltató határozza meg annak figyelembevételével, hogy egy vállalat milyen mértékben van kitéve lényeges ESG-kockázatoknak, és mennyire jól kezeli a vállalat a kockázati kitettségét. A kizárásos szűrők adatait a vállalat

tevékenységének figyelembevételével a harmadik fél adatszolgáltató határozza meg. A CIM eseti jelleggel kiegészítheti a harmadik fél adatszolgáltató ESG-értékelését a sajátjával. További részletekért tekintse meg a teljes weboldali közzétételt.

Adatforrások és -feldolgozás

A pozitív ESG-szűrő és az ESG-kizárások alkalmazása a Sustainalytics által biztosított ESG-minősítések és adatok alapján történik. A releváns adatok a szolgáltató weboldalán vagy a szolgáltatótól havonta kapott adatfolyamon keresztül érhetők el, és felhasználhatók abban a befektetési folyamatban, ahol a befektetési univerzumot meghatározzák, valamint időszakos monitorozásra (lásd fent). Mivel a pénzügyi termék környezeti és társadalmi jellemzőinek való megfelelés érdekében harmadik fél adatait használjuk fel, mi magunk nem végzünk semmilyen adatbecslést. Tisztában vagyunk vele, hogy a Sustainalytics a rendelkezésre álló adatok hiánya miatt a hozzánk beérkező ESG-adatoknak csak egy kis részét értékeli.

A CIM más nyilvánosan elérhető forrásokat, valamint külső brókerek kutatásait és a vállalat vezetésével folytatott megbeszélések során gyűjtött információkat is felhasználhat.

A módszerekre és adatokra vonatkozó korlátozások

Az ESG-adatokkal kapcsolatban vannak olyan általános kihívások, amelyek várhatóan az adatszolgáltatóunktól származó adatokra is vonatkoznak – idetartoznak (többek között) az adathiányok, az adatok késése az adatszolgáltatási határidők tekintetében, az adatszolgáltató és az adatforrások eltérő módszerei az adatok kiszámításához vagy becsléséhez, valamint a becslt és jelentett adatok közötti eltérések. Mivel ezek általános piaci korlátozások és nem kifejezetten a pénzügyi termékre vagy a kiválasztott adatszolgáltatókra vonatkoznak, úgy gondoljuk, hogy továbbra is képesek vagyunk kellőképpen megfelelni a pénzügyi termék által előmozdított jellemzőknek. Emellett egy szolgáltatókra vonatkozó felülvizsgálati és jóváhagyási belső folyamatot is fenntartunk, amely magában foglalja az adatszolgáltató adatkezelési megközelítésének, adatlefedettségének és módszertanának felülvizsgálatát.

Az esetleges adathiányok mérséklése érdekében a CIM kiegészítheti a harmadik fél adatszolgáltató ESG-értékelését a sajátjával.

Átvilágítás

A potenciális befektetések csak akkor kerülnek be a pénzügyi termék közé, ha megfelelnek a fent összefoglalt kötelező környezeti, társadalmi és irányítási („ESG”) elemeknek, amelyeket a befektetési folyamatban kötelező szűrőként valósítanak meg. Emellett az ESG-kritériumokkal foglalkozó befektetési csapatunk folyamatos belső megbeszéléseket folytat a pénzügyi termékbe történő befektetésekkel kapcsolatban.

Szerepvállalási politikák

A szerepvállalás közvetlenül nem része a pénzügyi termék által előmozdított környezeti vagy társadalmi befektetési stratégiának. Nem rendelkezünk olyan eljárásokkal, amelyek a fenntarthatósággal kapcsolatos vitákban alkalmazhatók lennének a befektetést fogadó vállalkozásoknál. Mindazonáltal együttműködünk a befektetést fogadó vállalkozásokkal a meghatalmazott útján történő szavazás preferenciája révén, amely egyes fenntarthatósági ügyekhez igazodó kérdésekre irányíthatja a szavazatokat.

Kijelölt referenciaérték

A pénzügyi termék nem jelölt ki referenciaértéket a környezeti vagy társadalmi jellemzőik elérésének érdekében.

Fontos információk

A Citi Private Banknál komolyan vesszük az adatainak védelmét. További információért látogasson el weboldalunkra:
<https://www.privatebank.citibank.com/privacy>

A luxemburgi kereskedelmi és cégnyilvántartásban B 200204 számon **bejegyzett Citibank Europe plc, Luxembourg Branch** a Citibank Europe plc fióktelepe. Az Európai Központi Bank és az oroszországi Központi Bank közös felügyelete alá tartozik. Ezenkívül a fogadó tagállam hatóságaként a Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) korlátozott szabályozása alá tartozik, és a CSSF-nél a B00000395 számon van bejegyezve. Irodájának címe: 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Luxemburgi Nagyhercegség

A Citibank Europe plc az oroszországi Központi Bank szabályozása alá tartozik. A Központi Bank nyilvántartásában C26553 hivatkozási számmal szerepel, és az Európai Központi Bank felügyeli. Székhelyének címe: 1 North Wall Quay, Dublin 1, Rország. A Citibank Europe plc Rországban van bejegyezve, cégjegyzékszáma: 132781. Az oroszországi Központi Bank szabályozása alá tartozik, hivatkozási száma: C26553.

© 2024 Citigroup Inc. Minden jog fenntartva. A Citi és a Citi with Arc Design a Citigroup vagy leányvállalatai bejegyzett szolgáltatásvédjegyei.