

Citi Global Equity ESG Focus Portfolio

Podsumowanie dotyczące ujawniania informacji na stronie internetowej

Rozporządzenie w sprawie ujawniania informacji związanych ze zrównoważonym rozwojem w sektorze usług finansowych („SFDR”) wymaga od nas podsumowania informacji podanych w ujawnieniu przed zawarciem umowy w odniesieniu do produktu finansowego, który promuje aspekty środowiskowe i/lub społeczne oraz pewnych innych informacji publikowanych na stronie internetowej. Niniejsze ujawnienie jest dokonywane w powyższych celach przez spółkę Citibank Europe plc, w odniesieniu do klientów jej oddziału w Luksemburgu w związku z Citi Global Equity ESG Focus Portfolio.

Brak celu dotyczącego zrównoważonych inwestycji

Produkt finansowy promuje aspekty środowiskowe lub społeczne, ale jego celem nie jest zrównoważona inwestycja.

Aspekty środowiskowe lub społeczne produktu finansowego

Produkt finansowy promuje wsparcie dla zasad inicjatywy Global Compact ONZ (UNGC) i unikanie inwestycji w niektóre działania stanowiące potencjalne zagrożenie dla ludzkiego zdrowia i dobrostanu poprzez stosowanie wiążących wykluczeń.

Strategia inwestycyjna

Procesie wyboru inwestycji przy użyciu danych od zewnętrznego dostawcy danych ESG i/lub oceny CIM stosuje się następujące wiążące elementy z zakresu ochrony środowiska, polityki społecznej i ładu korporacyjnego („ESG”):

- (i) do zakresu inwestycyjnego zostaje zastosowany pozytywny obraz ESG w celu zapewnienia, że inwestycje wykazują korzystne ratingi ESG (zgodnie z definicją naszego zewnętrznego dostawcy danych ESG); oraz
- (ii) stosuje się następujące wykluczenia: (a) spółki, które są „niezgodne” z zasadami UNGC lub zostały uznane za naruszające zasady UNGC przez naszego zewnętrznego dostawcę danych ESG i/lub w ramach oceny CIM; (b) spółki, w przypadku których ponad 10% przychodów (w poprzednim roku podatkowym spółki) pochodzi z określonej działalności; oraz (c) spółki bezpośrednio lub pośrednio powiązane z produkcją lub dystrybucją kontrowersyjnych rodzajów broni.

CIM może doraźnie uzupełnić ocenę ESG zewnętrznego dostawcy danych o własną ocenę. W oparciu o naszą wewnętrzną analizę fundamentalną możemy uwzględnić pozycje w produkcie finansowym, które, jak wynika z danych stron trzecich, wydają się nie spełniać dowolnego z powyższych elementów wiążących, w przypadku gdy uznamy, że dane stron trzecich są niewystarczające, niekompletne lub niedokładne, a nasza analiza fundamentalna wskazuje, że spółka spełnia powyższe elementy wiążące. Podobny proces stosujemy w przypadku emitentów, których nie obejmuje zewnętrzny dostawca danych. Na podobnej zasadzie możemy wykluczyć pozycje, które wydają się spełniać jedno lub więcej z powyższych kryteriów, ale w przypadku których nie zgadzamy się z danymi stron trzecich w oparciu o naszą analizę fundamentalną lub inne źródła danych.

Dobre praktyki w zakresie zarządzania spółek, w które dokonano inwestycji, są również uwzględniane w procesie due diligence inwestycji w oparciu o ocenę danych ESG stron trzecich. Więcej informacji można znaleźć w pełnym ujawnieniu informacji na stronie internetowej.

Udział inwestycji

Produkt finansowy zobowiązuje się do minimalnego udziału 80% inwestycji w celu uwzględnienia aspektów promowanych przez produkt finansowy. Pozostała część inwestycji w produkt finansowy składa się ze środków pieniężnych i ich ekwiwalentów, w tym papierów wartościowych emitowanych przez fundusze wzajemne rynku pieniężnego, utrzymywanych w celu efektywnego zarządzania portfelem. Produkt finansowy nie ma na celu dokonywania żadnych zrównoważonych inwestycji i nie uwzględnia unijnej systematyki, w związku z czym zgodne z systematyką jest 0% produktu finansowego. Oczekuje się, że cała ekspozycja na spółki, w które dokonano inwestycji, będzie bezpośrednia.

Monitorowanie aspektów środowiskowych lub społecznych

Strategia inwestycyjna produktu finansowego są wdrażane w ramach procesu inwestycyjnego, który co roku aktualizuje wyniki ESG produktu finansowego, a co miesiąc aktualizuje dane dotyczące wykluczeń, na podstawie których podejmujemy decyzje inwestycyjne. Jest to uzupełniane przez ocenę własną CIM. Dzięki temu inwestycje wykorzystywane w produkcie finansowym są dostosowane do wiążących elementów stosowanych przez produkt do promowania aspektów środowiskowych lub społecznych.

Metody

Indeks MSCI World Index wykorzystuje się do ustanowienia zakresu bazowego dla produktu finansowego, do których zastosowano pozytywny ekran ratingów ESG i wykluczające ekrany ESG w oparciu o ratingi i dane ESG stron trzecich. Ratingi ESG są określane przez dostawcę danych z uwzględnieniem stopnia, w jakim spółka jest narażona na istotne ryzyka ESG oraz tego, jak dobrze spółka zarządza swoją ekspozycją na ryzyko. Punkty danych dla obrazów wykluczających są określane przez zewnętrznego dostawcę danych poprzez odniesienie do działalności spółki. CIM może doraźnie uzupełnić

ocenę ESG zewnętrznego dostawcy danych o własną ocenę. Więcej informacji można znaleźć w pełnym ujawnieniu informacji na stronie internetowej.

Źródła i przetwarzanie danych

Pozytywny obraz ESG i wykluczenia ESG są stosowane przy użyciu ratingów i danych ESG dostarczanych przez Sustainalytics. Odpowiednie dane dostępne są na stronie internetowej dostawcy lub za pomocą źródła danych, które otrzymujemy od dostawcy co miesiąc, i wykorzystywane w procesie inwestycyjnym, gdzie definiowany jest zakres inwestycyjny oraz do okresowego monitorowania (patrz wyżej). Ponieważ wykorzystujemy dane podmiotów zewnętrznych, aby uwzględnić środowiskowe i społeczne aspekty produktu finansowego, sami nie szacujemy żadnych danych. Rozumiemy, że z uwagi na niedostępność danych niewielka ilość przekazywanych nam danych ESG jest przez Sustainalytics szacowana.

CIM może również korzystać z innych publicznie dostępnych zasobów, a także badań zewnętrznych brokerów i informacji zebranych podczas spotkań z kierownictwem spółki.

Ograniczenia dotyczące metod i danych

Istnieją ogólne wyzwania związane z danymi ESG, które naszym zdaniem mają również zastosowanie do danych pozyskiwanych od naszego dostawcy danych – obejmują one (między innymi) luki w danych, opóźnienia w raportowaniu danych, rozbieżności w zakresie metod dostawcy danych i źródeł danych związane z obliczaniem lub szacowaniem danych oraz rozbieżności między danymi szacunkowymi a raportowanymi. Ponieważ są to ogólne ograniczenia występujące na rynku, które nie są specyficzne dla produktu finansowego lub wybranego przez nas dostawcy danych, uważamy, że nadal jesteśmy w stanie należycie uwzględnić aspekty promowane przez produkt finansowy. Prowadzimy również wewnętrzny proces weryfikacji i zatwierdzania dostawców, który obejmuje przegląd podejścia dostawcy danych do zarządzania danymi, zakresu danych i metod.

CIM może uzupełnić ocenę ESG przeprowadzoną przez zewnętrznego dostawcę danych o własną ocenę w celu ograniczenia luk w danych.

Due diligence

Potencjalne inwestycje zostaną włączone do produktu finansowego tylko w przypadku, gdy będą zgodne z wiążącymi elementami ESG podsumowanymi powyżej, które są wdrażane w procesie inwestycyjnym jako siatki powiązań. Ponadto nasz zespół ds. inwestycji dedykowany ESG angażuje się w bieżące wewnętrzne rozmowy związane z inwestycjami w produkt finansowy.

Polityka dotycząca zaangażowania

Zaangażowanie nie jest bezpośrednio częścią środowiskowej lub społecznej strategii inwestycyjnej promowanej przez produkt finansowy. Nie posiadamy żadnych procedur mających zastosowanie do kontrowersji związanych ze zrównoważonym rozwojem w spółkach, w które dokonano inwestycji. Angażujemy się jednak w spółki, w które dokonano inwestycji, w oparciu o preferencje w zakresie głosowania przez pełnomocników – mogą one służyć do przekierowywania głosów na kwestie związane z wybranymi kwestiami zrównoważonego rozwoju.

Wyznaczony wskaźnik referencyjny

Produkt finansowy nie wyznaczył wskaźnika referencyjnego w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych.

Ważne informacje

Citi Private Bank poważnie traktujemy prywatność danych. Więcej informacji można znaleźć na naszej stronie internetowej:

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

Spółka Citibank Europe plc, oddział w Luksemburgu, zarejestrowana w luksemburskim rejestrze handlowym i spółek pod numerem B 200204, jest oddziałem Citibank Europe plc. Podlega wspólnemu nadzorowi Europejskiego Banku Centralnego i Banku Centralnego Irlandii. Ponadto podlega ograniczonym regulacjom ze strony Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) w roli organu przyjmującego państwa członkowskiego i jest zarejestrowana w CSSF pod numerem B00000395. Siedziba spółki znajduje się pod adresem 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Wielkie Księstwo Luksemburga.

Działalność Citibank Europe plc jest regulowana przez Bank Centralny Irlandii. Widnieje w rejestrze Banku Centralnego pod numerem referencyjnym C26553 i jest nadzorowana przez Europejski Bank Centralny. Siedziba spółki znajduje się pod adresem 1 North Wall Quay, Dublin 1, Ireland. Spółka Citibank Europe plc jest zarejestrowana w Irlandii pod numerem 132781. Jej działalność jest regulowana przez Bank Centralny Irlandii pod numerem referencyjnym C26553.

© 2024 Citigroup Inc. Wszelkie prawa zastrzeżone. Citi i Citi with Arc Design są zarejestrowanymi znakami usługowymi grupy Citigroup lub jej spółek zależnych.