

19 de julho de 2024

# Citi Global Equity ESG Focus Portfolio

## Resumo da divulgação do sítio Web

O Regulamento relativo à divulgação de informações relacionadas com a sustentabilidade no setor dos serviços financeiros ("SFDR") requer que elaboremos um resumo das informações fornecidas na nossa divulgação pré-contratual, no que respeita a um produto financeiro que promova características ambientais e/ou sociais, e a determinadas outras informações publicadas num sítio Web. Esta divulgação é efetuada para este efeito pelo Citibank Europe plc relativamente a clientes da sua sucursal no Luxemburgo, no que respeita ao Citi Global Equity ESG Focus Portfolio.

### ***Inexistência de um objetivo de investimento sustentável***

O produto financeiro promove características ambientais ou sociais, mas não tem como objetivo de investimento o investimento sustentável.

### ***Características ambientais ou sociais do produto financeiro***

O produto financeiro promove o apoio aos princípios do Pacto Global das Nações Unidas (UNGC) e procuram evitar investimentos em certas atividades com potencial para prejudicar a saúde e o bem-estar humanos, aplicando exclusões vinculativas.

### ***Estratégia de investimento***

Os seguintes elementos Ambientais, Sociais e de Governação Empresarial ("ESG") vinculativos são aplicados no processo de seleção de investimentos, utilizando dados de terceiros fornecedores de dados ESG e/ou a avaliação da CIM:

- (i) é aplicado um filtro ESG positivo ao universo de investimento, para garantir que os investimentos apresentam classificações ESG favoráveis (conforme indicado pelos nossos terceiros fornecedores de dados ESG); e
- (ii) são aplicadas as seguintes exclusões: (a) empresas "não conformes" com os Princípios do UNGC ou consideradas infratoras do UNGC pelos nossos terceiros fornecedores de dados ESG e/ou pela avaliação da CIM; (b) empresas com receitas superiores a 10% (no ano fiscal anterior da empresa) decorrentes de determinadas atividades; e (c) empresas com uma associação direta ou indireta ao fabrico ou distribuição de Armas Controversas.

Numa base ad-hoc, a CIM pode complementar a avaliação ESG do terceiro fornecedor de dados com a sua própria avaliação. Com base na nossa análise fundamental interna, podemos incluir posições nos produtos financeiros que, com base nos dados de terceiros, parecem falhar qualquer um dos elementos vinculativos acima mencionados, quando acreditamos que os dados de terceiros são insuficientes, incompletos ou imprecisos, e com base na nossa própria análise fundamental, a empresa está em conformidade com os elementos vinculativos acima. Seguimos um processo semelhante para os emitentes que não estão cobertos pelo terceiro fornecedor de dados. Da mesma forma, podemos excluir posições que parecem cumprir um ou mais dos critérios acima, mas apenas quando discordamos dos dados de terceiros com base na nossa própria análise fundamental ou noutras fontes de dados.

As práticas de boa governação das empresas beneficiárias do investimento também são consideradas no processo de devida diligência de investimento, com base numa classificação de dados ESG de terceiros. Consulte a divulgação completa no sítio Web para obter mais informações.

### ***Proporção de investimentos***

O produto financeiro compromete-se a uma proporção mínima de 80% de investimentos para atingir as características promovidas pelos produtos financeiros. A parte remanescente do investimento dos produtos financeiros consiste em caixa e equivalentes de caixa, incluindo valores mobiliários emitidos por fundos de investimento do mercado monetário, detidos para efeitos de uma gestão eficiente da carteira. O produto financeiro não visa efetuar quaisquer investimentos sustentáveis e não têm em consideração a taxonomia da UE e, como tal, 0% do produto financeiro está alinhado pela taxonomia. Espera-se que toda a exposição a empresas beneficiárias de investimento seja direta.

### ***Monitorização de características ambientais ou sociais***

A estratégia de investimento do produto financeiro é implementada através de um processo de investimento que atualiza anualmente as pontuações ESG do produto financeiro e, mensalmente, atualiza os dados de exclusão com base nos quais tomamos as nossas decisões de investimento. Isto é complementado pela própria avaliação da CIM. Isto assegura que os investimentos utilizados nos produtos financeiros estão alinhados com os elementos vinculativos utilizados por este produto para promover características ambientais ou sociais.

### ***Metodologias***

O MSCI World Index é utilizado para estabelecer um universo base para o produto financeiro, aos quais é aplicado um filtro de classificações ESG positivas e filtros ESG de exclusão com base em classificações e dados ESG de terceiros. As classificações ESG são determinadas pelo fornecedor de dados, tendo em consideração a medida em que uma empresa está exposta a riscos ESG significativos e o desempenho de uma empresa na gestão da sua exposição ao risco.

Os pontos de dados dos filtros de exclusão são determinados pelo terceiro fornecedor de dados, tendo em consideração as atividades da empresa. Numa base ad-hoc, o CIM pode complementar a avaliação ESG do fornecedor de dados terceiro por si próprio. Consulte a divulgação completa no sítio Web para obter mais informações.

#### **Fontes de dados e processamento**

O filtro ESG positivo e as exclusões ESG são aplicados utilizando classificações ESG e dados fornecidos pela Sustainalytics. Os dados relevantes são acedidos através do sítio Web do fornecedor ou de um feed de dados que recebemos mensalmente do fornecedor, e são utilizados no processo de investimento, em que o universo de investimento é definido e para monitorização periódica (consultar acima). Uma vez que utilizamos dados de terceiros para cumprir as características ambientais e sociais do produto financeiro, não estimamos nós próprios quaisquer dados. Sabemos que a Sustainalytics estima uma pequena parte dos dados ESG que recebemos devido à inexistência de dados disponíveis.

A CIM pode também utilizar outros recursos publicamente disponíveis, bem como a pesquisa e informação do corretor externo recolhidas durante reuniões com a administração da empresa.

#### **Limitações a metodologias e dados**

Existem desafios gerais associados a dados ESG, que esperamos serem também aplicáveis aos dados que utilizamos do nosso fornecedor de dados; estes incluem (entre outros) lacunas de dados, desfasamento de dados em termos de prazos de comunicação, metodologias divergentes entre fornecedores de dados e fontes de dados para o cálculo ou estimativa dos dados e discrepâncias entre dados estimados e comunicados. Uma vez que se trata de limitações gerais no mercado que não são específicas dos produtos financeiros ou do nosso fornecedor de dados selecionado, consideramos que ainda nos é possível cumprir adequadamente as características promovidas pelos produtos financeiros. Também mantemos um processo interno de revisão e aprovação de fornecedores que envolve a análise da abordagem do fornecedor de dados à gestão de dados, cobertura de dados e metodologias.

A CIM pode complementar a avaliação ESG do terceiro fornecedor de dados com o seu próprio objetivo de mitigar quaisquer lacunas de dados.

#### **Diligência devida**

Os potenciais investimentos apenas serão incluídos nos produtos financeiros se estiverem em conformidade com os elementos ESG vinculativos resumidos acima, que são implementados no processo de investimento como avaliações vinculativas. Além disso, a nossa equipa de investimento dedicada de ESG participa em debates internos contínuos relacionados com os investimentos nos produtos financeiros.

#### **Políticas de envolvimento**

O envolvimento não faz diretamente parte da estratégia de investimento ambiental ou social promovida pelos produtos financeiros. Não temos quaisquer procedimentos aplicáveis a controvérsias relacionadas com sustentabilidade em empresas beneficiárias de investimento. No entanto, interagimos com empresas beneficiárias de investimento através das nossas preferências de votação por procuração, que podem direcionar os votos para questões alinhadas com algumas matérias de sustentabilidade.

#### **Índice de referência designado**

O produto financeiro não designou um índice de referência com vista a atingir as suas características ambientais ou sociais.

## **Informações importantes**

A privacidade dos seus dados é muito importante para o Citi Private Bank. Para saber mais, visite o nosso sítio Web: <https://www.privatebank.citibank.com/privacy>

**Citibank Europe plc, Sucursal do Luxemburgo**, registado no Registo Comercial e das Sociedades do Luxemburgo sob o número B 200204, é uma sucursal do Citibank Europe plc. Está sujeito à supervisão conjunta do Banco Central Europeu e do Banco Central da Irlanda. Além disso, está sujeito a regulamentação limitada da Commission de Surveillance do Secteur Financier (a CSSF) na sua função de autoridade do Estado-Membro anfitrião e está registado na CSSF com o número B00000395. O endereço dos escritórios é 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Grão-Ducado do Luxemburgo.

**O Citibank Europe plc** encontra-se regulamentado pelo Banco Central da Irlanda. Consta do registo do Banco Central com o número de referência C26553 e é supervisionado pelo Banco Central Europeu. A sua sede social situa-se em 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irlanda. O Citibank Europe plc está registado na Irlanda sob o número de registo de sociedade 132781. É regulado pelo Banco Central da Irlanda com o número de referência C26553.

© 2024 Citigroup Inc. Todos os direitos reservados. Citi e Citi with Arc Design são marcas de serviço registadas do Citigroup ou das respetivas afiliadas.