

Citi Global Transformation Portfolio

Обобщение на оповестяването в уебсайта информация

Регламентът относно оповестяването на информация във връзка с устойчивостта в сектора на финансовите услуги („SFDR“) изисква да обобщаваме информацията, предоставена в нашето преддоговорно оповестяване по отношение на финансов продукт, който насърчава екологични и/или социални характеристики, както и определена друга информация, публикувана на даден уебсайт. Това оповестяване се прави за тези цели от Citibank Europe plc по отношение на клиенти на неговия люксембургски клон във връзка със Citi Global Transformation Portfolio

Без цел за устойчиви инвестиции

Тези финансови продукти насърчават екологични или социални характеристики, но нямат устойчиви инвестиции за своя инвестиционна цел.

Екологични или социални характеристики на финансовия продукт

Финансовите продукти насърчават положителния принос за постигането на Целите за устойчиво развитие на ООН (ЦУР на ООН) чрез инвестиране в компании, които имат значително отражение върху една или повече избрани от нас теми, свързани с устойчивостта (теми на Citi GTP), които са съобразени с една или повече ЦУР на ООН. Финансовите продукти насърчават подкрепата на принципите на Глобалния договор на ООН (UNGC) и се стремят да избягват инвестиции в определени дейности с потенциал да причинят вреда на човешкото здраве и благосъстояние чрез прилагане на обвързващи изключения.

Инвестиционна стратегия

В процеса по избор на инвестиция се прилагат следните обвързващи екологични, социални и управленски (ESG) елементи:

(i) Ние използваме положителни скрининг тестове, за да инвестираме само в световни публично търгувани дружества с приходи от минимум 30% през последната приключена фискална година, приписвани на една или повече от темите на Citi GTP. Дружествата, които не отговарят на този праг, но за които имаме достатъчно убеждения, че могат да достигнат прага в рамките на три години, могат да бъдат разглеждани за включване; дружествата, включени въз основа на този критерий, могат да обхващат до 20% от стойността на финансовите продукти; и

(ii) Използваме отрицателни скрининг тестове въз основа на данни от трети страни, за да изключим: (а) дружества, които получават приходи от производството, продажбата и/или трансфера на противопехотни мини или касетъчни боеприпаси или от производството и/или преработката на тютюн, (б) дружества, които се считат за нарушители на UNGC.

Добрите управленски практики на дружествата, в които се инвестира, също се вземат предвид в процеса на инвестиционна надлежна проверка въз основа на ESG рейтинг за данни от трети страни. Вижте целия текст за оповестяването в информацията на уебсайта за допълнителни подробности.

Дял от инвестициите

Финансовите продукти поемат ангажимент за минимален дял от 80% от инвестициите, за да постигнат характеристиките, насърчавани от финансовите продукти. Останалата част от инвестицията на финансовите продукти може да включва парични средства и парични еквиваленти, включително ценни книжа, емитирани от взаимни фондове на паричния пазар, държани за целите на ефективното управление на портфейла. Финансовите продукти нямат за цел да правят устойчиви инвестиции и не вземат предвид таксономията на ЕС и като такива, 0% от финансовите продукти са в съответствие с таксономията. Всички експозиции към дружествата, в които се инвестира, се очаква да бъдат преки.

Мониторинг на екологичните или социалните характеристики

Потенциалните инвестиции ще бъдат включени във финансовите продукти само ако отговарят на обвързващите екологични, социални и управленски (ESG) елементи, обобщени по-горе. Данните, използвани за целите на измерване на експозициите към приходи, се актуализират ежегодно, а тези за изключенията се актуализират на тримесечие.

Методики за екологичните или социалните характеристики

Обхватът на инвестициите на финансовите продукти първоначално е намален чрез положителни проверки, за да включва световни публично търгувани дружества с приходи от минимум 30% през последната приключена фискална година, приписвани на една или повече теми на Citi GTP. Дружествата, които не отговарят на този праг, но за които имаме достатъчно убеждения, че могат да достигнат прага в рамките на три години, могат да бъдат разглеждани за включване; дружествата, включени въз основа на този критерий, могат да обхващат до 20% от финансовите продукти.

Данните на трети страни се използват за прилагане на отрицателни скрининг тестове за допълнително определяне на обхвата на инвестициите. Прилагаме изключения въз основа на приходите, в съответствие с UNGC, за да изключим дружества, които получават приходи от производството, продажбата и/или трансфера на противопехотни мини или касетъчни боеприпаси или от производството и/или преработката на тютюн.

Също така прилагаме отрицателни проверки, за да изключим дружества, които биват смятани за нарушители на UNGC. Методиката на доставчика на данни от трета страна е субективна и може да бъде разглеждана от нас като непълна. Също така ще обсъдим и прегледаме конкретни дружества, които сме отбелязали, че отговарят на Глобалния договор на ООН, въпреки мнението на доставчика на данни от трета страна, което е субективно и води до несъответстваща оценка, и може да ги разгледаме за инвестиции. Изключенията въз основа на този критерий могат да обхващат до 20% от портфейла. Вижте целия текст за оповестяването в информацията на уебсайта за допълнителни подробности.

Източници и обработване на данни

Начислените приходи, свързани с темите на Citi GTP, се оценяват чрез директни оповестявания на публични дружества. Тези данни се извличат директно от дружествата или чрез Bloomberg, и/или Factset. Тъй като тази информация ще се основава на публично оповестени данни на дружеството, не очакваме да бъде приблизителна. Изключенията се прилагат, като се използват данните, предоставени от Sustainalytics. Съответните данни са достъпни чрез платформата на доставчика или поток данни, който получаваме от доставчика ежесечно, и се използват в инвестиционния процес, където се определя обхвата на инвестициите, както и за периодичен мониторинг (вижте по-горе). Наясно сме, че Sustainalytics осигурява приблизителна преценка за част от получаваните от нас ESG данни поради липсата на налични данни.

Ограничения на методиките и данните

Има общи предизвикателства, свързани с ESG данните, които очакваме да се прилагат и към данните, които използваме от нашия доставчик на данни и от пазара – те включват (но не се изчерпват с) пропуски в данните, забавяне на данните по отношение на сроковете за отчитане, различни методики между доставчиците на данни и източниците на данни за изчисляването или оценката на данните и несъответствия между прогнозните и отчетените данни. Тъй като това са общи ограничения на пазара, които не са специфични за финансовите продукти или избрания от нас доставчик на данни, ние смятаме, че въпреки това можем да постигнем по подходящ начин характеристиките, насърчавани от финансовите продукти. Ние също така поддържаме вътрешен процес на преглед и одобрение на доставчика, който включва преглед на подхода на доставчика на данни към управлението на данните, обхвата на данните и методиките.

Надлежна проверка

Потенциалните инвестиции ще бъдат включени във финансовите продукти само ако отговарят на обобщените по-горе обвързващи екологични, социални и управленски (ESG) елементи, които са внедрени в инвестиционния процес като обвързващи скрининги. Освен това нашият инвестиционен екип, занимаващ се с ESG, участва в текущи вътрешни дискусии, свързани с инвестициите във финансовите продукти.

Политики за ангажираност

Ангажираността пряко не е част от екологичната или социалната инвестиционна стратегия, насърчавана от финансовите продукти. Ние нямаме процедури, приложими за свързаните с устойчивостта противоречия в дружествата, в които се инвестира. Въпреки това ние се ангажираме с дружества, в които се инвестира, чрез нашите предпочитания за гласуване чрез пълномощник, което може да насочи гласовете към въпроси, съобразени с някои теми на устойчивостта.

Определен референтен бенчмарк

Финансовите продукти не са определили референтен бенчмарк за целите на постигане на своите екологични или социални характеристики.

Важна информация

В Citi Private Bank се отнасяме сериозно към поверителността на Вашите данни. За да научите повече, моля, посетете нашия уебсайт:

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

Citibank Europe plc, Luxembourg Branch, регистрирано в търговския и фирмен регистър на Люксембург под номер В 200204, е клон на Citibank Europe plc. То е под съвместния надзор на Европейската централна банка и Централната банка на Ирландия. Освен това то подлежи на ограничено регулиране от Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) в ролята си на орган на приемащата държава членка и е регистрирано в CSSF под номер B00000395. Офисът му е на адрес 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Велико херцогство Люксембург.

Citibank Europe plc е поднадзорно на Централната банка на Ирландия. Фигурира в регистъра на Централната банка с референтен номер C26553 и подлежи на надзор от Европейската централна банка. Седалището му е на адрес 1 North Wall Quay, Dublin 1, Ирландия. Citibank Europe plc е регистрирано в Ирландия с регистрационен номер на дружеството 132781. Поднадзорно е на Централната банка на Ирландия под референтен номер C26553.

© 2023 Citigroup Inc. Всички права запазени. Citi и Citi с Arc Design са регистрирани марки за услуги на Citigroup или нейните дъщерни дружества.