

Citi Equity (US and Global) ESG Focus Portfolios

Обобщение на оповестяването в уебсайт 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 US Equity ESG Focus Portfolio и Citi Global Equity ESG Focus Portfolio

Без цел за устойчиви инвестиции

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

Екологични или социални характеристики на финансовия продукт

Финансовите продукти насърчават подкрепата за 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

Следните обвързващи екологични, социални и управленски (ESG) елементи се прилагат в процеса на избор на инвестиция, като се използват данни от доставчици на ESG данни от трети страни:

- (i) положителен ESG скрининг се прилага към инвестиционната вселена, за да се гарантира, че инвестициите демонстрират благоприятни ESG рейтинги (както е дефинирано от нашите доставчици на ESG данни от трети страни); и
- (ii) се прилагат следните изключения: а) дружества, които са „несъвместими“ с принципите на Глобалния договор на ООН или се считат за нарушители на Глобалния договор на ООН от нашите доставчици на ESG данни от трети страни; б) дружества, които имат повече от 10% приходи (през предходната финансова година на дружеството) от определени дейности; и в) дружества, пряко или косвено свързани с производството или разпространението на противоречиви оръжия и цивилни огнестрелни оръжия.

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. Моля, вижте целия текст за оповестяването в уебсайт информация 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 се състои от 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

Инвестиционните стратегии на финансовите продукти се прилагат чрез инвестиционен процес, който опреснява ESG резултатите на финансовите продукти всяка година, а ежемесечно актуализира данните за изключване, въз основа на които вземаме нашите инвестиционни решения. Това гарантира, че инвестициите, използвани във финансовите продукти, са приведени в съответствие с обвързващите елементи, използвани от този продукт за насърчаване на екологични или социални характеристики.

Методики за екологичните или социалните характеристики

Използват се индексът MSCI US Index (Citi US Equity ESG Focus Portfolio) и индексът MSCI World Index (Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) за установяване на базова вселена за съответните финансови продукти, към които се прилагат скрининг за положителни ESG рейтинги и ESG скрининг за изключване въз основа на ESG рейтинги и данни от трети страни. ESG рейтингите се определят от доставчика на данни, като се има предвид степента, в която дадено дружество е изложено на съществени ESG рискове и доколко добре дружеството управлява рисковата си експозиция. Точките за данни за скринингите за изключване се определят от доставчика на данни от трети страни, като се имат предвид дейностите на дружеството. Моля, вижте целия текст за оповестяването в уебсайт информация за допълнителни подробности.

Източници и обработване на данни

Положителният ESG скрининг и изключенията относно ESG се прилагат с помощта на ESG рейтинги и данни, предоставени от Sustainalytics. Съответните данни са достъпни чрез уебсайта на доставчика или поток данни, който получаваме от доставчика ежесечно, и се използват в инвестиционния процес, където се дефинира инвестиционната вселена, както и за периодичен мониторинг (вижте по-горе). Тъй като използваме данни от трети страни, за да постигнем екологичните и социални характеристики на финансовите продукти, ние сами не оценяваме никакви данни. Наясно сме, че Sustainalytics оценява малко количество 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 – те включват (между другото) 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 изборения от нас доставчик на данни, ние считаме, 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 В00000395. 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 С26553 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 С26553.

© 2022 Citigroup Inc. Всички права запазени. Citi и Citi с Arc Design са регистрирани марки за услуги на Citigroup или нейните дъщерни дружества.