

Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolios

Zhrnutie obsahu zverejneného na webovom sídle

Nariadenie o zverejňovaní informácií o udržateľnom financovaní („SFDR“) vyžaduje, aby sme sumarizovali informácie uvedené v obsahu zverejnenom pred uzatvorením zmluvy s ohľadom na finančný produkt, ktorý presadzuje environmentálne a/alebo sociálne vlastnosti, ako aj určité ďalšie informácie zverejnené na webovom sídle. Toto zverejnenie sa vykonáva pre potreby spoločnosti Citibank Europe plc vo vzťahu ku klientom jej luxemburskej pobočky s ohľadom na portfólio Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolio s pevným výnosom

Žiadne ciele v oblasti udržateľných investícií

Tieto finančné produkty presadzujú environmentálne, resp. sociálne vlastnosti, ich investičným cieľom však nie sú udržateľné investície.

Environmentálne, resp. sociálne vlastnosti finančného produktu

Tieto finančné produkty presadzujú zásady iniciatívy OSN s názvom Global Compact (UNGC – UN Global Compact), pričom sa uplatňovaním záväzných vylúčení snažia vyhnúť investovaniu do určitých činností, ktoré by mohli viesť k poškodeniu zdravia a pohody osôb.

Investičná stratégia

V rámci procesu výberu investícií sa pomocou údajov od poskytovateľov údajov o Environmentálnom, sociálnom a podnikovom riadení („ESG“) v pozícii tretej strany uplatňujú nasledujúce záväzné prvky ESG:

- (i) na investičné prostredie sa aplikuje negatívny skríning ESG, aby sa eliminovali investície vykazujúce nepriaznivý rating ESG (podľa definície našich poskytovateľov údajov o ESG v pozícii tretej strany); a
- (ii) uplatnia sa nasledujúce vylúčenia: (a) spoločnosti, ktoré nespĺňajú zásady UNGC alebo ktoré považujú naši poskytovatelia údajov o ESG v pozícii tretej strany za porušovateľov zásad UNGC; (b) spoločnosti, ktorých výnosy (za predchádzajúci fiškálny rok spoločnosti) z určitých činností predstavujú viac ako 10 %; a (c) spoločnosti s priamou alebo nepriamou väzbou na výrobu alebo distribúciu kontroverzných zbraní a osobných strelných zbraní.

Dobré postupy správy spoločností, do ktorých sa investuje, sú zohľadnené aj v procese náležitej starostlivosti pri investovaní vychádzajúcom z ratingu údajov o ESG udeleného tretími stranami. Viac informácií nájdete v úplnom zverejnení obsahu webového sídla.

Podiel investícií

Na dosiahnutie vlastností presadzovaných finančnými produktmi musí byť ich minimálny podiel v investíciách 80 %. Zvyšnú časť investovania do finančných produktov tvorí hotovosť a hotovostné ekvivalenty vrátane cenných papierov vydaných podielovými fondmi peňažného trhu, ktoré sú držané na účely efektívnej správy portfólia.

Cieľom finančných produktov nie sú žiadne udržateľné investície, pričom nezohľadňujú taxonómiu EÚ a 0 % z nich je v súlade s touto taxonómiou. Predpokladá sa, že každá expozícia vplyvu spoločností, do ktorých sa investuje, bude priama.

Monitorovanie environmentálnych alebo sociálnych vlastností

Investičné stratégie finančných produktov sa realizujú prostredníctvom procesu investovania, ktorý každoročne obnovuje výsledky finančných produktov v oblasti ESG, pričom na mesačnej báze aktualizuje údaje o vylúčení, na základe ktorých robíme naše investičné rozhodnutia. Tým je zabezpečené naviazanie investícií použitých v príslušných finančných produktoch na záväzné prvky použité takýmto produktom pri presadzovaní environmentálnych alebo sociálnych vlastností.

Metodiky pri environmentálnych alebo sociálnych vlastnostiach

1. Na vytvorenie základného prostredia pre príslušné finančné produkty, na ktoré sa na základe ratingov a údajov tretích strán o ESG aplikovali negatívny skríning ESG a vylučovacie skríniny ESG, sa používa ročný až desaťročný index FTSE US Broad Investment Grade s výnimkou MBS. Ratingy ESG určuje poskytovateľ údajov, pričom zohľadňuje rozsah expozície spoločnosti voči závažným rizikám v oblasti ESG a mieru, do akej spoločnosť takúto expozíciu voči rizikám dokáže zvládť. Miesta údajov pre vylučovacie skríniny určuje poskytovateľ údajov v pozícii tretej strany s ohľadom na činnosti spoločnosti. Viac informácií nájdete v úplnom zverejnení obsahu webového sídla.

Zdroje údajov a ich spracovanie

Negatívny skrining ESG a vylúčenia v zmysle ESG sa uplatňujú s použitím ratingov a údajov o ESG poskytnutých spoločnosťou Sustainalytics. Relevantné údaje sú k dispozícii prostredníctvom webového sídla poskytovateľa alebo dátového feedu, ktorý dostávame od poskytovateľa raz mesačne, pričom ich využívame v procese investovania, kde definujeme prostredie, ako aj na účely periodického monitorovania (pozri vyššie).

Keďže pri dosahovaní environmentálnych a sociálnych vlastností finančných produktov využívame údaje tretích strán, sami nerobíme žiadne odhady údajov. Sme si vedomí toho, že z dôvodu nedostatku dostupných údajov robí spoločnosť Sustainalytics odhady z malého množstva nami získaných údajov o ESG.

Obmedzenia metodík a údajov

S údajmi o ESG sú spojené všeobecné problémy, ktoré sa podľa našich predpokladov týkajú aj údajov získaných od nášho poskytovateľa údajov – patria sem (okrem iného) dátové medzery, oneskorenia údajov v zmysle časových rozvrhov predkladania správ, odlišné metodiky medzi poskytovateľmi údajov a ich zdrojmi na účely výpočtu alebo odhadu údajov a nesúlad medzi odhadovanými a vykazovanými údajmi.

Keďže tieto všeobecné obmedzenia na trhu sa netýkajú iba finančných produktov, resp. nami vybraného poskytovateľa údajov, máme za to, že stále dokážeme v príslušnej miere dosahovať vlastnosti presadzované finančnými produktmi. Okrem toho udržiavame proces previerky a schvaľovania interných predajcov, ktorého súčasťou je preskúmanie prístupu poskytovateľa údajov k správe údajov, ich pokrytiu a k metodikám.

Náležitá starostlivosť

Potenciálne investície sa stanú súčasťou finančných produktov iba v prípade, ak sú v súlade s vyššie zhrnutými záväznými prvkami Environmentálneho, sociálneho a podnikového riadenia („ESG“) zavedenými v procese investovania vo forme záväzných skriningov. Náš investičný tím určený pre oblasť ESG sa okrem toho zapája do prebiehajúcich interných diskusií, ktoré sa týkajú investovania do finančných produktov.

Politiky zapájania

Zapájanie nie je priamou súčasťou environmentálnej, resp. sociálnej stratégie presadzovanej finančnými produktmi. Nemáme žiadne postupy použiteľné pri sporoch týkajúcich sa udržateľnosti v spoločnostiach, do ktorých sa investuje.

Určená referenčná hodnota

Finančné produkty nemajú určenú referenčnú hodnotu na účely dosahovania environmentálnych a sociálnych vlastností.

Dôležité informácie

V spoločnosti Citi Private Bank berieme ochranu vašich osobných údajov vážne. Viac informácií nájdete na webovom sídle:

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

Spoločnosť **Citibank Europe plc, Luxembourg Branch** zaregistrovaná v luxemburskom Živnostenskom a obchodnom registri pod číslom B 200204 je pobočkou spoločnosti Citibank Europe plc., pričom podlieha spoločnému dohľadu zo strany Európskej centrálnej banky a Írskej centrálnej banky. Okrem toho podlieha obmedzenej regulácii zo strany Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) ako orgánu hostiteľského členského štátu, u ktorého je zaregistrovaná pod číslom B00000395. Adresa jej sídla je 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Luxemburské vojvodstvo.

Citibank Europe plc podlieha regulácii zo strany Írskej centrálnej banky. V registri Centrálnej banky je uvedená pod referenčným číslom C26553 a podlieha dohľadu zo strany Európskej centrálnej banky. Adresa jej sídla je 1 North Wall Quay, Dublin 1, Írsko. Citibank Europe plc je zaregistrovaná v Írsku a jej IČO je 132781. Podlieha regulácii zo strany Centrálnej banky s referenčným číslom C26553.

© 2022 Citigroup Inc. Všetky práva vyhradené. Citi a Citi so symbolom oblúka sú registrovanými ochrannými zámkami spoločnosti Citigroup alebo jej pobočiek pre služby.