

# Citi Global Transformation Portfolio

## Podsumowanie informacji ujawnianych na stronie internetowej

Zgodnie z rozporządzeniem SFDR mamy obowiązek podsumować informacje ujawniane przez nas przed zawarciem umowy w odniesieniu do produktu finansowego, który promuje aspekty środowiskowe i/lub społeczne, a także niektóre inne informacje opublikowane na stronie internetowej. Poniższe informacje zostają ujawnione w tym celu przez spółkę Citibank Europe plc wobec klientów jej oddziału w Luksemburgu w odniesieniu do produktu Citi Global Transformation Portfolio.

### Brak celu w postaci zrównoważonych inwestycji

Przedmiotowe produkty finansowe promują aspekty środowiskowe lub społeczne, ale nie mają celu inwestycyjnego w postaci zrównoważonych inwestycji.

### Aspekty środowiskowe lub społeczne produktu finansowego

Produkty finansowe promują pozytywny wkład w realizację celów zrównoważonego rozwoju ONZ (UN SDG) poprzez inwestowanie w spółki o znaczącej ekspozycji z tytułu jednego lub większej liczby wybranych przez nas tematów dotyczących zrównoważonego rozwoju (tematy Citi GTP), które są dostosowane do jednego lub większej liczby celów zrównoważonego rozwoju ONZ. Produkty finansowe mają również na celu wspieranie zasad UN Global Compact (UNGC) i unikanie inwestycji w niektóre rodzaje działalności, które mogą być potencjalnie szkodliwe dla zdrowia i dobrobytu ludzi, poprzez stosowanie wiążących wykluczeń.

### Strategia inwestycyjna

W procesie wyboru inwestycji stosuje się następujące wiążące elementy ESG:

(i) Wykorzystujemy pozytywną kontrolę wyłącznie w celu inwestowania w globalne spółki notowane na giełdzie, które uzyskały co najmniej 30% przychodów za ostatni ukończony rok podatkowy w związku z jednym lub większą liczbą tematów Citi GTP. Wszelkie spółki, które nie osiągną tego progu, ale co do których mamy wystarczające przekonanie, że mogą osiągnąć ten próg w ciągu trzech lat, mogą zostać uznane za kwalifikujące się do włączenia; spółki włączone na podstawie tego kryterium mogą stanowić do 20% wartości produktów finansowych; oraz

(ii) Wykorzystujemy negatywne kontrole oparte na zewnętrznych danych, aby wykluczyć: (a) spółki, które czerpią jakiegokolwiek przychody z produkcji, sprzedaży i/lub transferu min przeciwpiechotnych lub bomb kasetowych lub z produkcji i/lub wytwarzania tytoniu, (b) spółki, które są uznawane za naruszające zasady UNGC.

Dobre praktyki w zakresie zarządzania spółek, w które dokonano inwestycji, są również uwzględniane w procesie due diligence opartym na zewnętrznej ocenie danych ESG. Szczegółowe informacje można znaleźć w pełnym ujawnieniu na stronie internetowej.

### Udział inwestycji

Produkty finansowe zobowiązują się do minimalnego procentowego udziału inwestycji w wysokości 80% w celu uwzględnienia aspektów promowanych przez produkty finansowe. Pozostała część inwestycji produktów finansowych może obejmować środki pieniężne i ich ekwiwalenty, w tym papiery wartościowe emitowane przez fundusze wspólnego inwestowania rynku pieniężnego, utrzymywane do celów efektywnego zarządzania portfelem. Produkty finansowe nie zamierzają dokonywać zrównoważonych inwestycji i nie uwzględniają unijnej systematyki; pod tym względem 0% produktów finansowych jest dostosowanych do systematyki. Oczekuje się, że wszelka ekspozycja wobec spółek, w które dokonano inwestycji, będzie bezpośrednia.

### Monitorowanie aspektów środowiskowych lub społecznych

Potencjalne inwestycje zostaną włączone do produktów finansowych tylko wtedy, gdy będą zgodne z wiążącymi elementami ESG, o których mowa powyżej. Dane wykorzystywane do pomiaru ekspozycji przychodów są aktualizowane raz do roku, a dane stosowane do wykluczeń – raz na kwartał.

### Metody opracowane w związku z aspektami środowiskowymi lub społecznymi

Spektrum inwestycyjne produktów finansowych jest początkowo zawężane za pomocą pozytywnych kontroli, tak aby obejmowało globalne spółki notowane na giełdzie, które uzyskały co najmniej 30% przychodów za ostatni ukończony rok podatkowy w związku z jednym lub większą liczbą tematów Citi GTP. Wszelkie spółki, które nie osiągną tego progu, ale co do których mamy wystarczające przekonanie, że mogą osiągnąć ten próg w ciągu trzech lat, mogą zostać uznane za kwalifikujące się do włączenia; spółki objęte tym kryterium mogą stanowić do 20% produktów finansowych.

Dane zewnętrznych dostawców są wykorzystywane do zastosowania negatywnej kontroli w celu dalszego zdefiniowania spektrum inwestycyjnego. Stosujemy kryterium wykluczające oparte na przychodach, zgodnie z zasadami UNGC, w celu wykluczenia spółek, które czerpią jakiegokolwiek przychody z produkcji, sprzedaży i/lub transferu min przeciwpiechotnych lub bomb kasetowych lub z produkcji i/lub wytwarzania tytoniu.

Stosujemy również negatywne kontrole, aby wykluczyć spółki, które są uznawane za naruszające zasady UNGC. Metodologia zewnętrznego dostawcy danych jest subiektywna i może być przez nas postrzegana jako niekompletna. Będziemy również omawiać i weryfikować konkretne spółki, które zostały przez nas oznaczone jako zgodne z zasadami UN Global Compact pomimo subiektywnej opinii zewnętrznego dostawcy danych skutkującej negatywną

oceną w zakresie zgodności, i możemy rozważyć dokonanie w nich inwestycji. Wyjątki oparte na tym kryterium mogą obejmować do 20% portfela. Szczegółowe informacje można znaleźć w pełnym ujawnieniu na stronie internetowej.

#### **Źródła i przetwarzanie danych**

Przypisanie przychodów do tematów Citi GTP jest oceniane przy użyciu bezpośrednich, publicznych ujawnień dotyczących spółek. Dane te są pozyskiwane bezpośrednio od spółek lub za pośrednictwem agencji Bloomberg i/lub Factset. Ponieważ informacje te będą oparte na publicznie ujawnionych danych spółek, nie spodziewamy się, że będą szacowane. Wykluczenia stosowane są przy użyciu danych dostarczonych przez Sustainalytics. Odpowiednie dane są przeglądane za pośrednictwem platformy dostawcy lub źródła danych, które otrzymujemy od dostawcy co miesiąc, i są wykorzystywane w początkowych etapach procesu inwestycyjnego ze zdefiniowanym spektrum inwestycyjnym oraz do okresowego monitorowania (patrz powyżej). Rozumiemy, że z powodu braku dostępnych danych niektóre dane ESG otrzymywane przez nas są szacowane przez Sustainalytics.

#### **Ograniczenia dotyczące metod i danych**

Istnieją ogólne wyzwania związane z danymi ESG, które prawdopodobnie dotyczą też wykorzystywanych przez nas danych pochodzących od dostawców danych oraz z rynku. Są to m.in. luki w danych, opóźnienia w danych pod względem terminów składania sprawozdań, rozbieżne metody obliczania lub szacowania danych między różnymi dostawcami danych i źródłami danych oraz rozbieżności pomiędzy szacowanymi a zgłaszanymi danymi. Ponieważ są to ograniczenia rynkowe o charakterze ogólnym, które nie są specyficzne dla produktów finansowych ani wybranych przez nas dostawców danych, uważamy, że nadal będziemy w stanie odpowiednio uwzględniać aspekty promowane przez produkty finansowe. Prowadzimy również wewnętrzny proces weryfikacji i zatwierdzania dostawców, który obejmuje przegląd podejścia dostawcy danych do zarządzania danymi, zakresu danych i metodologii.

#### **Due diligence**

Potencjalne inwestycje zostaną włączone do produktów finansowych tylko wtedy, gdy będą zgodne z wiążącymi elementami ESG wspomnianymi powyżej, a stosowanymi w procesie inwestycyjnym w charakterze wiążących kontroli. Nasz zespół inwestycyjny ds. ESG uczestniczy ponadto w bieżących rozmowach wewnętrznych związanych z inwestycjami w produkty finansowe.

#### **Polityka dotycząca zaangażowania**

Zaangażowanie nie jest bezpośrednio częścią strategii inwestycji środowiskowych lub społecznych promowanej przez produkty finansowe. Nie dysponujemy żadnymi procedurami mającymi zastosowanie do problemów związanych ze zrównoważonym rozwojem w spółkach, w które dokonano inwestycji. Angażujemy się jednak w działalność takich spółek poprzez wykonywanie prawa głosu za pośrednictwem pełnomocników, dzięki czemu możemy nakierować głosowanie na sprawy zgodne z niektórymi kwestiami związanymi ze zrównoważonym rozwojem.

#### **Wyznaczony wskaźnik referencyjny**

Produkty finansowe nie wyznaczyły wskaźnika referencyjnego w celu uwzględnienia swoich aspektów środowiskowych lub społecznych.

## **Ważne informacje**

W Citi Private Bank poważnie traktujemy prywatność Twoich danych. Aby dowiedzieć się więcej, odwiedź naszą stronę internetową:

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

Spółka **Citibank Europe plc, Luxembourg Branch**, zarejestrowana w luksemburskim rejestrze handlu i spółek pod numerem B 200204, jest oddziałem spółki Citibank Europe plc. Podlega ona wspólnemu nadzorowi ze strony Europejskiego Banku Centralnego i Centralnego Banku Irlandii. Ponadto podlega ona ograniczonej regulacji przez Commission de Surveillance du Secateur Financier (CSSF) w roli organu przyjmującego państwa członkowskiego i jest zarejestrowana w CSSF pod numerem B00000395. Jej siedziba znajduje się pod adresem 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Wielkie Księstwo Luksemburga.

Spółka **Citibank Europe plc** jest regulowana przez Centralny Bank Irlandii. Widnieje ona w rejestrze Centralnego Banku pod numerem referencyjnym C26553 i jest nadzorowana przez Europejski Bank Centralny. Jej siedziba znajduje się pod adresem 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irlandia. Spółka Citibank Europe plc jest zarejestrowana w Irlandii pod numerem rejestracyjnym spółki 132781. Jest ona regulowana przez Centralny Bank Irlandii pod numerem referencyjnym C26553.

© 2023 Citigroup Inc. Wszelkie prawa zastrzeżone. Citi oraz Citi with Arc Design są zarejestrowanymi znakami usługowymi spółki Citigroup lub jej podmiotów zależnych.