

Citi Equity (US and Global) ESG Focus Portfolios

Podsumowanie dotyczące ujawniania informacji na stronie internetowej

Rozporządzenie w sprawie ujawniania informacji związanych ze zrównoważonym rozwojem w sektorze usług finansowych ('SFDR') wymaga od nas podsumowania informacji podanych w ujawnieniu przed zawarciem umowy w odniesieniu do produktu finansowego, który promuje aspekty środowiskowe i/lub społeczne oraz pewnych innych informacji publikowanych na stronie internetowej. Niniejsze ujawnienie jest dokonywane w powyższych celach przez spółkę Citibank Europe plc, w odniesieniu do klientów jej oddziału w Luksemburgu związanych z Citi US Equity ESG Focus Portfolio i Citi Global Equity ESG Focus Portfolio

Brak zrównoważonego celu inwestycyjnego

Niniejsze produkty finansowe promują aspekty środowiskowe lub społeczne, ale nie mają one w swoim założeniu zrównoważonego inwestowania jako celu inwestycyjnego.

Aspekty środowiskowe lub społeczne produktu finansowego

Produkty finansowe promują wsparcie dla zasad Global Compact ONZ (UNGC) i unikanie inwestycji w niektóre działania stanowiące potencjalne zagrożenie dla ludzkiego zdrowia i dobrobytu poprzez stosowanie wiążących wykluczeń.

Strategia inwestycyjna

Następujące wiążące elementy środowiskowe, społeczne i ładu korporacyjnego ('ESG') są stosowane w procesie wyboru inwestycji przy użyciu danych pochodzących od zewnętrznych dostawców danych ESG:

- (i) pozytywny obraz ESG jest ujęty w zakresie inwestycyjnym w celu zapewnienia, że inwestycje wykazują korzystne oceny ESG (zgodnie z definicją naszych zewnętrznych dostawców danych ESG); oraz
- (ii) stosuje się następujące wyłączenia: (a) przedsiębiorstwa, które działają niezgodnie z zasadami UNGC lub są uznane przez naszych zewnętrznych dostawców danych ESG za naruszające UNGC; (b) przedsiębiorstwa, które osiągają przychody przekraczające 10% (w ich poprzednim roku podatkowym) z określonej działalności; oraz (c) przedsiębiorstwa mające bezpośredni lub pośredni związek z produkcją lub dystrybucją broni kontrowersyjnej i broni palnej do użytku cywilnego.

Dobre praktyki zarządzania przedsiębiorstw inwestycyjnych są również brane pod uwagę w procedurze badania należytej staranności inwestycji w oparciu o ocenę danych ESG opracowaną przez podmiot zewnętrzny. W celu uzyskania więcej informacji należy zapoznać się z pełnym ujawnieniem informacji na stronie internetowej.

Udział w inwestycjach

Produkty finansowe wiążą się z minimalnym udziałem 80% inwestycji w celu osiągnięcia cech przez nie promowanych. Pozostałą część inwestycji produktów finansowych stanowią środki pieniężne i ich ekwiwalenty, w tym papiery wartościowe emitowane przez fundusze inwestycyjne rynku pieniężnego, utrzymywane w celu sprawnego zarządzania portfelem. Produkty finansowe nie służą dokonywaniu żadnych zrównoważonych inwestycji i nie uwzględniają taksonomii UE, w związku z czym 0% produktów finansowych jest do niej dostosowanych. Oczekuje się, że cała ekspozycja na przedsiębiorstwa będące przedmiotem inwestycji będzie bezpośrednia.

Monitorowanie aspektów środowiskowych lub społecznych

Strategie inwestycyjne produktów finansowych są realizowane poprzez proces inwestycyjny, który corocznie aktualizuje wyniki ESG produktów finansowych i co miesiąc aktualizuje dane dotyczące wykluczenia, na podstawie których podejmujemy decyzje inwestycyjne. Dzięki temu inwestycje wykorzystywane w produktach finansowych są dostosowane do wiążących elementów wykorzystywanych przez nie do promowania aspektów środowiskowych lub społecznych.

Metodologie dotyczące aspektów środowiskowych lub społecznych

MSCI US Index (Citi US Equity ESG Focus Portfolio) i MSCI World Index (Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) są wykorzystywane do ustanowienia zakresu bazowego dla odpowiednich produktów finansowych, do których stosuje się obraz pozytywnych ocen ESG i obrazy wykluczające ESG w oparciu o oceny i dane ESG podmiotów zewnętrznych. Oceny ESG są określane przez dostawcę danych poprzez uwzględnienie zakresu, w jakim przedsiębiorstwo jest narażone na istotne ryzyka ESG oraz jak dobrze przedsiębiorstwo zarządza ekspozycją na ryzyko. Punkty danych dla obrazów wykluczających są określane

przez zewnętrznego dostawcę danych poprzez odniesienie do działalności przedsiębiorstwa. W celu uzyskania więcej informacji należy zapoznać się z pełnym ujawnieniem informacji na stronie internetowej.

Źródła danych i ich przetwarzanie

Pozytywny obraz ESG i wykluczenia ESG są stosowane przy użyciu ocen i danych ESG dostarczanych przez Sustainalytics. Odpowiednie dane dostępne są na stronie internetowej dostawcy lub za pomocą źródła danych, które otrzymujemy od dostawcy co miesiąc, i wykorzystywane w procesie inwestycyjnym, gdzie definiowany jest zakres inwestycyjny oraz do okresowego monitorowania (patrz wyżej). Ponieważ wykorzystujemy dane podmiotów zewnętrznych, aby uzyskać środowiskowe i społeczne aspekty produktów finansowych, sami nie szacujemy żadnych danych. Rozumiemy, że Sustainalytics szacuje niewielką ilość danych ESG, które otrzymujemy z powodu braku dostępnych danych.

Ograniczenia dotyczące metodologii i danych

Istnieją ogólne wyzwania związane z danymi ESG, które naszym zdaniem mają również zastosowanie do danych pozyskiwanych od naszego dostawcy danych - obejmują one (między innymi) luki w danych, opóźnienia w raportowaniu danych, rozbieżne metodologie pomiędzy dostawcami danych i źródłami danych w zakresie obliczania lub szacowania danych oraz rozbieżności pomiędzy danymi szacunkowymi a raportowanymi. Ponieważ są to ogólne ograniczenia występujące na rynku, które nie są specyficzne dla produktów finansowych lub wybranego przez nas dostawcy danych, uważamy, że nadal jesteśmy w stanie odpowiednio uzyskać 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.

Należyta staranność

Potencjalne inwestycje zostaną włączone do produktów finansowych tylko wtedy, gdy będą zgodne z wiążącymi elementami środowiskowymi, społecznymi i ładu korporacyjnego ('ESG') podsumowanymi powyżej, które są wdrażane w procesie inwestycyjnym jako siatki powiązań. Ponadto nasz zespół ds. inwestycji dedykowany ESG angażuje się w bieżące wewnętrzne rozmowy związane z inwestycjami w produkty finansowe.

Polityka zaangażowania

Zaangażowanie nie jest bezpośrednio częścią strategii inwestycji środowiskowych lub społecznych promowanych przez produkty finansowe. Nie mamy żadnych procedur dotyczących sporów związanych ze zrównoważonym rozwojem w przedsiębiorstwach inwestycyjnych. Jednakże angażujemy się w sprawy spółek, w które inwestujemy, poprzez nasze preferencje wyrażone w głosowaniu przez pełnomocnika, które mogą ukierunkować wybory na kwestie związane z niektórymi zagadnieniami zrównoważonego rozwoju.

Wyznaczony wskaźnik odniesienia

Produkty finansowe nie wyznaczyły wskaźnika odniesienia w celu uzyskania swoich aspektów środowiskowych lub społecznych.

Ważne informacje

W Citi Private Bank poważnie traktujemy prywatność danych. W celu uzyskania więcej informacji należy odwiedzić naszą stronę internetową:

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

Spółka **Citibank Europe plc, Luxembourg Branch**, zarejestrowana w luksemburskim rejestrze handlowym i spółek pod numerem B 200204, jest oddziałem Citibank Europe plc. Podlega wspólnemu nadzorowi Europejskiego Banku Centralnego i Banku Centralnego Irlandii. Ponadto podlega ograniczonym regulacjom ze strony 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.

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

© 2022 Citigroup Inc. Wszelkie prawa zastrzeżone. Citi i Citi with Arc Design są zarejestrowanymi znakami usługowymi grupy Citigroup lub jej spółek zależnych.