

# Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolios

## A weboldali közzététel összefoglalója

A fenntarthatósággal kapcsolatos közzétételekről szóló rendelet (az „SFDR”) előírja, hogy a szerződéskötés előtti tájékoztatónkban összefoglaljuk a környezeti és/vagy társadalmi jellemzőket elősegítő pénzügyi termékekre vonatkozó információkat, valamint bizonyos egyéb, a weboldalon közzétett információkat. Ezt a közzétételt a Citibank Europe plc a luxemburgi fióktelepének ügyfelei vonatkozásában, a Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolio kapcsán erre a célra készítette.

### **Nincs fenntartható befektetési célkitűzés**

Ezek a pénzügyi termékek előmozdítják a környezeti vagy társadalmi jellemzők érvényesülését, de nem rendelkeznek fenntartható befektetési célkitűzéssel.

### **A pénzügyi termék környezeti vagy társadalmi jellemzői**

A pénzügyi termékek előmozdítják az ENSZ Globális Megállapodásának (UNGC) alapelveit, és kötelező érvényű kizárások alkalmazásával igyekeznek elkerülni bizonyos tevékenységekbe történő befektetéseket, amelyek potenciálisan károsíthatják az emberi egészséget és jólétet.

### **Befektetési stratégia**

A befektetés kiválasztási folyamatában a következő kötelező környezeti, társadalmi és irányítási („ESG”) elemeket alkalmazzuk, harmadik fél ESG-adatszolgáltatók adatainak felhasználásával:

- (i) negatív ESG-szűrőt alkalmazunk a befektetési univerzumban a kedvezőtlen ESG-minősítést mutató befektetések kiküszöböléséhez (a harmadik fél ESG-adatszolgáltatóink által meghatározottak szerint); és
- (ii) a következő kizárásokat alkalmazzuk: (a) olyan vállalatok, amelyek „nem felelnek meg” az UNGC alapelveinek, vagy harmadik fél ESG-adatszolgáltatóink szerint megsértik az UNGC alapelveit; (b) olyan vállalatok, amelyek bizonyos tevékenységekből (a vállalat előző pénzügyi évében) több mint 10%-os bevétellel rendelkeznek; és (c) olyan vállalatok, amelyek közvetlen vagy közvetett kapcsolatban állnak különösen nagy kárt okozó fegyverek és polgári lőfegyverek gyártásával vagy terjesztésével.

A befektetést fogadó vállalkozások jó irányítási gyakorlatát a befektetés átvilágítási folyamatának során is figyelembe vesszük, harmadik fél ESG-adatminősítése alapján. További részletekért tekintse meg a teljes weboldali közzétételt.

### **A befektetések aránya**

A pénzügyi termékek által támogatott tulajdonságok elérése érdekében a pénzügyi termékek a befektetések minimum 80%-át teszik ki. A pénzügyi termékek befektetésének fennmaradó részét a hatékony portfóliókezelés érdekében tartott pénzeszközök és pénzeszközökkel egyenértékű eszközök teszik ki, beleértve a pénzpiaci befektetési alapok által kibocsátott értékpapírokat.

A pénzügyi termékek nem szándékoznak fenntartható befektetéseket megvalósítani, és nem veszik figyelembe az uniós taxonómiai rendeletet, így a pénzügyi termékek 0%-a áll összhangban a taxonómiai rendelettel. A befektetést fogadó vállalkozásokkal szembeni összes kitétség várhatóan közvetlen lesz.

### **Környezeti vagy társadalmi jellemzők monitoringja**

A pénzügyi termékek befektetési stratégiái egy befektetési folyamaton keresztül valósulnak meg, amely évente frissíti a pénzügyi termékek ESG-pontszámait, és havonta frissíti azokat a kizárásra vonatkozó adatokat, amelyek alapján befektetési döntéseinket meghozzuk. Ez biztosítja, hogy a pénzügyi termékekben alkalmazott befektetések összhangban legyenek a termék által a környezeti vagy társadalmi jellemzők előmozdítására használt kötelező elemekkel.

### **Környezeti vagy társadalmi jellemzők módszertana**

1. A vonatkozó pénzügyi termékek alapuniverzumának létrehozására az FTSE US Broad Investment Grade 1-10 years ex-MBS Index szolgál, amelyre negatív ESG-minősítési szűrőt és kizárásos ESG-szűrőket alkalmazunk harmadik felek ESG-minősítései és adatai alapján. Az ESG-minősítéseket az adatszolgáltató határozza meg annak figyelembevételével, hogy egy vállalat milyen mértékben van kitéve lényeges ESG-kockázatoknak, és mennyire jól

kezeli a vállalat a kockázati kitettséget. A kizárások szűrők adatait a társaság tevékenységének figyelembe vételével a harmadik fél adatszolgáltató határozza meg. További részletekért tekintse meg a teljes weboldali közzétételt.

#### **Adatforrások és -feldolgozás**

A negatív ESG-szűrő és az ESG-kizárások alkalmazása a Sustainalytics által biztosított ESG-minősítések és adatok alapján történik. A releváns adatok a szolgáltató weboldalán vagy a szolgáltatótól havonta kapott adatfolyamon keresztül érhetők el, és felhasználhatók abban befektetési folyamatban, ahol a befektetési univerzumot meghatározzák, valamint időszakos monitorozásra (lásd fent).

Mivel a pénzügyi termékek környezeti és társadalmi jellemzőinek való megfelelés érdekében harmadik fél adatait használjuk fel, mi magunk nem végzünk semmilyen adatbecslést. Tisztában vagyunk vele, hogy a Sustainalytics a rendelkezésre álló adatok hiánya miatt a hozzánk beérkező ESG-adatoknak csak egy kis részét értékeli.

#### **A módszerekre és adatokra vonatkozó korlátozások**

Az ESG-adatokkal kapcsolatban vannak olyan általános kihívások, amelyek várhatóan az adatszolgáltatóunktól származó adatokra is vonatkoznak – idetartoznak (többek között) az adathiányok, az adatok késése az adatszolgáltatási határidők tekintetében, az adatszolgáltatók és az adatforrások eltérő módszerei az adatok kiszámításához vagy becsléséhez, valamint a becslt és jelentett adatok közötti eltérések.

Mivel ezek általános piaci korlátozások és nem kifejezetten a pénzügyi termékekre vagy a kiválasztott adatszolgáltatónkra vonatkoznak, úgy gondoljuk, hogy továbbra is képesek vagyunk kellőképpen megfelelni a pénzügyi termékek által előmozdított jellemzőknek. Emellett egy szolgáltatóra vonatkozó felülvizsgálati és jóváhagyási belső folyamatot is fenntartunk, amely magában foglalja az adatszolgáltató adatkezelési megközelítésének, adatlefedettségének és módszertanának felülvizsgálatát.

#### **Átvilágítás**

A potenciális befektetések csak akkor kerülnek be a pénzügyi termékek közé, ha megfelelnek a fent összefoglalt kötelező környezeti, társadalmi és irányítási („ESG”) elemeknek, amelyeket a befektetési folyamatban kötelező szűrőként valósítanak meg. Emellett az ESG-kritériumokkal foglalkozó befektetési csapatunk folyamatos belső megbeszéléseket folytat a pénzügyi termékekbe történő befektetésekkel kapcsolatban.

#### **Szerepvállalási politikák**

A szerepvállalás közvetlenül nem része a pénzügyi termékek által előmozdított környezeti vagy társadalmi befektetési stratégiának. Nem rendelkezünk olyan eljárásokkal, amelyek a fenntarthatósággal kapcsolatos vitákban alkalmazhatók lennének a befektetést fogadó vállalkozásoknál.

#### **Kijelölt referenciaérték**

A pénzügyi termékek nem jelöltek ki referenciaértéket a környezeti vagy társadalmi jellemzőik elérésének érdekében.

## Fontos információk

A Citi Private Banknál komolyan vesszük az Ön adatainak védelmét. További információért látogasson el weboldalunkra:

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

A luxemburgi kereskedelmi és cégnyilvántartásban B 200204 számon bejegyzett **Citibank Europe plc luxemburgi fiókja** a Citibank Europe plc fióktelepe. Az Európai Központi Bank és az Írországi Központi Bank közös felügyelete alá tartozik. Ezenkívül a fogadó tagállam hatóságaként a Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) korlátozott szabályozása alá tartozik, és a CSSF-nél a B00000395 számon van bejegyezve. Irodájának címe: Bourmicht, 8070 Bertrange, Luxemburgi Nagyhercegség

A **Citibank Europe plc** az Írországi Központi Bank szabályozása alatt áll. A Központi Bank nyilvántartásában C26553 hivatkozási számmal szerepel, és az Európai Központi Bank felügyeli. Székhelyének címe: 1 North Wall Quay, Dublin 1, Írország. A Citibank Europe plc Írországban van bejegyezve, cégjegyzékszáma: 132781. Az Írországi Központi Bank szabályozása alatt áll, hivatkozási száma: C26553.

© 2022 Citigroup Inc. Minden jog fenntartva. A Citi és a Citi with Arc Design a Citigroup vagy leányvállalatai bejegyzett szolgáltatásvédjegyei.