

Citi Global Transformation Portfolio

Shrnutí zveřejněných informací uvedených na webových stránkách

Nařízení o zveřejňování informací o udržitelném financování („SFDR“) vyžaduje, abychom shrnuli informace uvedené v předmluvních informacích o finančním produktu, který podporuje environmentální a/nebo sociální vlastnosti, a některé další informace zveřejněné na internetových stránkách. Toto prohlášení za tímto účelem provádí Citibank Europe plc s ohledem na klienty své lucemburské pobočky v souvislosti s portfoliem Citi Global Transformation Portfolio

Žádný cíl udržitelných investic

Tyto finanční produkty podporují environmentální nebo sociální vlastnosti, ale jejich investičním cílem není udržitelné investování.

Environmentální nebo sociální vlastnosti finančního produktu

Finanční produkty podporují pozitivní přispění k plnění cílů udržitelného rozvoje OSN („cíle udržitelného rozvoje OSN“) tím, že investují do společností, které se významně podílejí na jednom nebo více námi vybraných tématech udržitelného rozvoje („témata Citi GTP“), které jsou v souladu s jedním nebo více cíli udržitelného rozvoje OSN. Finanční produkty se také snaží podporovat zásady UN Global Compact (UNGC) a vyhnout se investicím do určitých činností, které by mohly způsobit škody na lidském zdraví a blahu, uplatňováním závazných výjimek.

Investiční strategie

Následující závazné prvky ESG platí v procesu výběru investic:

(i) Prostřednictvím pozitivního prověřování investujeme pouze do globálních veřejně obchodovaných společností, jejichž výnosy za poslední ukončený fiskální rok dosahují minimálně 30 % a jsou spojeny s jedním nebo více tématy Citi GTP. Společnosti, které tuto hodnotu nespĺňují, ale u nichž jsme dostatečně přesvědčeni, že by ji mohly do tří let splnit, mohou být zváženy k zařazení; společnosti zařazené na základě tohoto kritéria mohou tvořit až 20 % hodnoty finančních produktů; a

(ii) Používáme negativní prověřování založené na údajích třetích stran k vyloučení: (a) společností, které mají jakýkoli výnos z výroby, prodeje a/nebo převodu protipěchotních min nebo kazetových bomb nebo z výroby a/nebo produkce tabáku, b) společností, které jsou považovány za porušovatele zásad UNGC.

Postupy řádné správy a řízení společností, do nichž bylo investováno, jsou rovněž zohledněny v procesu kontroly investic na základě hodnocení údajů ESG třetí stranou. Pro podrobnější informace viz úplná verze prohlášení na webových stránkách.

Poměr investic

Finanční produkty se zavazují k minimálnímu podílu 80 % investic pro dosažení vlastností, které finanční produkty podporují. Zbývající část investic finančních produktů může zahrnovat hotovost a peněžní ekvivalenty, včetně cenných papírů emitovaných podílovými fondy peněžního trhu, držaných pro účely efektivní správy portfolia. Finanční produkty nemají v úmyslu provádět žádné udržitelné investice a nezohledňují taxonomii EU, a proto je 0 % finančních produktů v souladu s taxonomií. Předpokládá se, že veškerá expozice vůči společnostem, do nichž je investováno, bude přímá.

Sledování environmentálních nebo sociálních vlastností

Potenciální investice budou do finančních produktů zařazeny pouze v případě, že splňují výše shrnuté závazné prvky ESG. Údaje používané pro účely měření expozic výnosů se aktualizují jednou ročně a údaje pro účely vyloučení se aktualizují čtvrtletně.

Metodiky pro environmentální nebo sociální vlastnosti

Investiční portfolio finančních produktů je nejprve zúženo pomocí pozitivního prověřování tak, aby zahrnovalo globální veřejně obchodované společnosti, jejichž výnosy za poslední ukončený fiskální rok dosahují minimálně 30 % a jsou spojeny s jedním nebo více tématy Citi GTP. Společnosti, které tuto hodnotu nespĺňují, ale u nichž jsme dostatečně přesvědčeni, že by ji mohly do tří let splnit, mohou být zváženy k zařazení; společnosti zařazené na základě tohoto kritéria mohou tvořit až 20 % hodnoty finančních produktů.

Údaje třetích stran se používají k negativnímu prověřování, aby se dále vymezil soubor investic. V souladu se zásadami UNGC uplatňujeme vyloučení na základě výnosů, abychom vyloučili společnosti, které mají jakékoli výnosy z výroby, prodeje a/nebo převodu protipěchotních min nebo kazetových bomb nebo z výroby a/nebo zpracování tabáku.

Používáme také negativní prověřování, abychom vyloučili společnosti, které jsou považovány za porušovatele zásad UNGC. Metodika poskytovatele dat třetí strany je subjektivní a může být námi považována za neúplnou. Projednáme a prověříme také konkrétní společnosti, které jsme označili jako společnosti, které splňují požadavky UN Global Compact, přestože subjektivní názor třetí strany poskytující údaje vedl k hodnocení, že nesplňují požadavky, a můžeme je tak zvážít k investicím. Výjimky založené na tomto kritériu mohou tvořit až 20 % portfolia. Pro podrobnější informace viz úplná verze prohlášení na webových stránkách.

Zdroje a zpracování údajů

Přiřazení výnosů k tématům Citi GTP se posuzuje na základě přímých informací zveřejňovaných veřejnými společnostmi. Tyto údaje jsou získávány přímo od společností nebo prostřednictvím agentury Bloomberg a/nebo Factset. Vzhledem k tomu, že tyto informace budou vycházet z veřejně dostupných údajů společnosti, nepředpokládáme, že budou odhadovány. Vyloučení jsou aplikována na základě údajů poskytnutých společností Sustainalytics. Příslušné údaje jsou přístupné přes platformu poskytovatele nebo přes datový kanál, který od něj každý měsíc dostáváme, a využívají se na začátku investičního procesu, kde se definuje soubor investic, a k pravidelnému monitoringu (viz výše). Chápeme, že společnost Sustainalytics odhaduje některé údaje ESG, které dostáváme, a to kvůli nedostatku dostupných údajů.

Omezení metodik a údajů

S údaji ESG jsou spojeny obecné problémy, jež se podle našeho očekávání týkají i údajů, které využíváme od našich poskytovatelů a z trhu – patří k nim (mimo jiné) mezery v údajích, zpoždění údajů z hlediska lhůt pro jejich vykazování, rozdílné metodiky poskytovatelů údajů a zdrojů údajů pro výpočet nebo odhad údajů a nesrovnalosti mezi odhadovanými a vykazovanými údaji. Vzhledem k tomu, že se jedná o obecná omezení na trhu, která nejsou specifická pro finanční produkty ani námi zvolené poskytovatele údajů, domníváme se, že jsme stále schopni vhodně naplnit vlastnosti prosazované finančními produkty. Udržujeme také interní proces kontroly a schvalování dodavatelů, který zahrnuje přezkoumání přístupu poskytovatele údajů ke správě údajů, pokrytí údajů a metodiky.

Kontrola

Potenciální investice budou do finančních produktů zařazeny pouze v případě, že splní výše shrnuté závazné prvky ESG, které jsou obsažené v investičním procesu jako závazná kritéria. Naš investiční tým specializovaný na ESG se navíc průběžně zapojuje do interních diskusí týkajících se investic do finančních produktů.

Zásady zapojení

Zapojení není přímou součástí environmentální ani sociální investiční strategie podporované finančními produkty. Nemáme žádné postupy, které by se vztahovaly na kontroverze související s udržitelností ve společnostech, do nichž je investováno. Do společností, do nichž investujeme, jsme zapojení přes naše preference pro hlasování v zastoupení. Ty mohou směřovat hlasování k otázkám souvisejícím s některými otázkami udržitelnosti.

Stanovená referenční hodnota

Finanční produkty nemají stanovenou referenční hodnotu pro účely dosažení svých environmentálních nebo sociálních vlastností.

Důležité informace

V Citi Private Bank bereme ochranu vašich osobních údajů vážně. Podrobnější informace naleznete na naší webové stránce:

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

Citibank Europe plc, lucemburská pobočka, zapsaná v lucemburském obchodním rejstříku pod číslem B 200204, je pobočkou Citibank Europe plc. Podléhá společnému dohledu Evropské centrální banky a Central Bank of Ireland. Dále podléhá omezené regulaci ze strany Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) jako orgánu hostitelského členského státu a je registrována u CSSF pod číslem B00000395. Její obchodní kancelář se nachází na adrese 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Lucemburské velkovévodství.

Citibank Europe plc je regulována Central Bank of Ireland. Je zapsána v registru centrální banky pod referenčním číslem C26553 a podléhá dohledu Evropské centrální banky. Registrované sídlo má na adrese 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irsko. Citibank Europe plc je registrována v Irsku pod registračním číslem 132781. Spadá pod dohled Centrální banky pod referenčním číslem C26553.

© 2023 Citigroup Inc. Všechna práva vyhrazena. Citi a Citi with Arc Design jsou registrované značky služeb společnosti Citigroup nebo jejich přidružených společností.