

Citi Global Transformation Portfolio

Informacijos interneto svetainėje atskleidimo santrauka

Su tvarumu susijusios finansinės informacijos atskleidimo reglamentu esame įpareigoti apibendrinti mūsų ikisutartinę informaciją apie finansinį produktą, kuriuo skatinami aplinkos ir (arba) socialiniai ypatumai, ir tam tikrą kitą interneto svetainėje skelbiamą informaciją. Šiuo tikslu „Citibank Europe plc“ pateikia šį informacijos atskleidimą, susijusį su jos Liuksemburgo filialo klientais, apie Citi Global Transformation Portfolio

Nėra tvarių investicijų tikslo

Šiais finansiniais produktais skatinami aplinkos ar socialiniai ypatumai, tačiau jų investicinis tikslas nėra tvarios investicijos.

Finansinio produkto aplinkos ar socialiniai ypatumai

Finansiniais produktais skatinamas teigiamas indėlis siekiant Jungtinių Tautų darnaus vystymosi tikslų (toliau – JT DVT) investuojant į bendroves, reikšmingai susijusias su viena ar daugiau mūsų atrinktų tvarumo temų (toliau – „Citi“ GTP temos), kurios atitinka vieną ar daugiau JT DVT. Finansiniais produktais taip pat siekiama prisidėti prie JT pasaulinio susitarimo (toliau – JTSPS) principų ir vengiama investicijų į tam tikrą veiklą, galinčią pakenkti žmonių sveikatai ir gerovei, taikant privalomo atmetimo principą.

Investavimo strategija

Investicijų atrankos procese taikomi šie privalomi ESG elementai:

- i) Naudojame teigiamos atrankos metodą, pagal kurį investuojame tik į tas pasaulines bendroves, kurių akcijomis prekiaujama viešai ir kurios per paskutinius pasibaigusius finansinius metus ne mažiau kaip 30 % pajamų gavo iš vienos ar daugiau „Citi“ GTP temų. Atrinktos gali būti ir šios kartelės neatitinkančios bendrovės, jei turime pakankamai pagrindo manyti, kad jos gali pasiekti šią kartelę per trejus metus. Pagal šį kriterijų įtrauktos bendrovės gali sudaryti ne daugiau 20 % finansinių produktų vertės.
- ii) Naudojame neigiamos atrankos metodą, pagrįstą trečiųjų šalių duomenimis, kad atstume: a) bendroves, kurios gauna pajamų iš priešpėstinių minų ar kasetinių bombų gamybos, pardavimo ir (arba) perdavimo arba iš tabako gamybos, b) bendroves, kurios laikomos JTSPS pažeidėjomis.

Atliekant išsamų investicijų patikrinimo procesą pagal trečiųjų šalių ESG duomenų reitingą taip pat atsižvelgiama į investuojamųjų bendrovių gero valdymo praktiką. Išsami informacija pateikta visame informacijos atskleidime interneto svetainėje.

Investicijų dalis

Finansiniais produktais įsipareigojama skirti ne mažesnę kaip 80 % investicijų dalį šiais finansiniais produktais skatinamiems ypatumams pasiekti. Likusią finansinių produktų investicijų dalį gali sudaryti pinigai ir pinigų ekvivalentai, įskaitant pinigų rinkos savitarpio fondų išleistus vertybinius popierius, laikomus siekiant efektyvaus portfelio valdymo. Finansiniais produktais neketinama daryti tvarių investicijų ir neatsižvelgiama į ES taksonomiją, todėl 0 % šių finansinių produktų atitinka taksonomiją. Tikimasi, kad visos investicijos į investuojamąsias bendroves bus tiesioginės.

Aplinkos ar socialinių ypatumų stebėseną

Galimos investicijos į finansinius produktus bus įtrauktos tik tuo atveju, jei jos atitiks pirmiau apibendrintus privalomus ESG elementus. Pajamų pozicijoms įvertinti naudojami duomenys atnaujinami kasmet, o atmetimams įvertinti naudojami duomenys – kas ketvirtį.

Aplinkos ar socialinių ypatumų metodikos

Finansinių produktų investicinis horizontas iš pradžių susiaurinamas naudojant teigiamos atrankos metodą, pagal kurį įtraukiamos pasaulinės bendrovės, kurių akcijomis prekiaujama viešai ir kurios per paskutinius pasibaigusius finansinius metus ne mažiau kaip 30 % pajamų gavo iš vienos ar daugiau „Citi“ GTP temų. Atrinktos gali būti ir šios kartelės neatitinkančios bendrovės, jei turime pakankamai pagrindo manyti, kad jos gali pasiekti šią kartelę per trejus metus. Pagal šį kriterijų įtrauktos bendrovės gali sudaryti ne daugiau 20 % finansinių produktų.

Pasitelkus trečiųjų šalių duomenis pritaikomas neigiamos atrankos metodas siekiant dar tiksliau apibrėžti investicinį horizontą. Taikome pajamomis pagrįstą atmetimą vadovaudamiesi JTSPS, kad atstume bendroves, kurios gauna pajamų iš priešpėstinių minų ar kasetinių bombų gamybos, pardavimo ir (arba) perdavimo arba iš tabako gamybos.

Neigiamą atranką taikome ir siekdami atmesti bendroves, kurios laikomos JTSPS pažeidėjomis. Trečiųjų šalių duomenų teikėjų metodika yra subjektyvi, todėl galime ją laikyti nepakankama. Taip pat aptarsime ir peržiūrėsime konkrečias bendroves, kurias išskyrėme kaip atitinkančias JT pasaulinio susitarimo reikalavimus nepaisant subjektyvios trečiųjų šalių duomenų teikėjo nuomonės, dėl kurios buvo gautas reikalavimų neatitinkantis reitingas, ir galėsime svarstyti investuoti į tokias bendroves. Išimtis pagal šį kriterijų gali sudaryti ne daugiau 20 % portfelio. Išsami informacija pateikta visame informacijos atskleidime interneto svetainėje.

Duomenų šaltiniai ir tvarkymas

Pajamų priskyrimas pagal „Citi“ GTP temas įvertinamas naudojant bendrovių tiesiogiai viešai atskleidžiamą informaciją. Šie duomenys gaunami tiesiogiai iš bendrovių arba „Bloomberg“ ir (arba) „Factset“. Kadangi ši informacija pagrįsta viešai paskelbtais bendrovių duomenimis, nesitikime, kad ji bus apytiksliai įvertinta. Atmetimai atliekami remiantis „Sustainalytics“ pateiktais duomenimis. Atitinkami duomenys pasiekiami per teikėjo platformą arba duomenų srautą, kurį iš teikėjo gauname kas mėnesį, ir naudojami pradinuose investicinio proceso etapuose, kai apibrėžiamas investavimo horizontas, taip pat periodiniam stebėjimui (žr. aukščiau). Suprantame, kad dėl turimų duomenų trūkumo kai kuriuos mūsų gaunamus ESG duomenis „Sustainalytics“ įvertina apytiksliai.

Metodikos ir duomenų apribojimai

Yra bendrų su ESG duomenimis susijusių iššūkių, kurie, mūsų manymu, kils ir su duomenimis, kuriuos pasitelkiame iš savo duomenų teikėjų ir rinkos – pavyzdžiui, duomenų spragų, duomenų atsilikimo nuo ataskaitų teikimo terminų, skirtingų duomenų teikėjų ir duomenų šaltinių metodikų duomenims apskaičiuoti ar apytiksliai įvertinti bei apytiksliai įvertintų ir ataskaitose pateiktų duomenų skirtumų. Kadangi tai yra bendri rinkos apribojimai, kurie nėra būdingi būtent šiems finansiniams produktams ar mūsų pasirinktiems duomenų teikėjams, manome, kad vis tiek galime tinkamai atitikti šiais finansiniais produktais skatinamus ypatumus. Taip pat taikome vidinį partnerių peržiūros ir patvirtinimo procesą, kuris apima duomenų teikėjo vykdomo duomenų valdymo, duomenų aprėpties ir metodikų peržiūrą.

Išsamus patikrinimas

Galimos investicijos į finansinius produktus bus įtrauktos tik tuo atveju, jei jos atitiks pirmiau apibendrintus privalomus ESG elementus, kurie bus įtraukti į investavimo procesą kaip privalomos atrankos. Be to, mūsų ESG investicijų komanda nuolat vykdo vidines diskusijas, susijusias su investicijomis į finansinius produktus.

Dalyvavimo politika

Dalyvavimas nėra tiesioginė šiais finansiniais produktais skatinamos aplinkos ar socialinių investicijų strategijos dalis. Neturime jokių procedūrų, kurios būtų taikomos sprendžiant su tvarumu susijusius ginčus investuojamosiose bendrovėse. Tačiau investuojamosiose bendrovėse dalyvaujame balsuodami per įgaliotinius, kurie gali balsuoti už klausimus, atitinkančius kai kuriuos tvarumo aspektus.

Nustatytasis referencinis lyginamasis indeksas

Finansiniams produktams nenustatytas referencinis lyginamasis indeksas, kuriuo būtų siekiama užtikrinti jų aplinkos ar socialinius ypatumus.

Svarbi informacija

„Citi Private Bank“ jūsų duomenų privatumą vertina rimtai. Norėdami sužinoti daugiau, apsilankykite mūsų interneto svetainėje:

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

„Citibank Europe plc“ Liuksemburgo filialas, įregistruotas Liuksemburgo prekybos ir įmonių registre numeriu B 200204, yra „Citibank Europe plc“ filialas. Jį bendrai prižiūri Europos Centrinis Bankas ir Airijos Centrinis Bankas. Be to, jį kaip priimančiosios valstybės narės instituciją ribota apimtimi reguliuoja *Commission de Surveillance du Secateur Financier* (CSSF) ir jis yra registruotas CSSF numeriu B00000395. Jo būstinės adresas yra 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Liuksemburgo Didžioji Hercogystė.

„Citibank Europe plc“ valdo Airijos Centrinis Bankas. Ji įregistruota Centrinio Banko registre numeriu C26553 ir ją prižiūri Europos Centrinis Bankas. Jos būstinės adresas yra 1 North Wall Quay, Dublin 1, Airija. „Citibank Europe plc“ registruota Airijoje, įmonės registracijos numeris 132781. Ją valdo Airijos Centrinis Bankas, kuriame ji registruota numeriu C26553.

© „Citigroup Inc.“, 2023 m. Visos teisės saugomos. „Citi“ ir „Citi“ logotipas su lankeliu yra „Citigroup“ arba jos filialų registruoti paslaugų ženklai.