

Citi Equity (US and Global) ESG Focus Portfolios

Sintesi dell'informativa destinata al sito web

Il regolamento relativo all'informativa sulla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari (SFDR) ci impone di riassumere le informazioni fornite all'interno della nostra informativa precontrattuale in relazione ai prodotti finanziari che promuovono caratteristiche ambientali e/o sociali e alcune altre informazioni pubblicate sul sito web. La presente informativa viene pubblicata a tale scopo da Citibank Europe plc in relazione ai clienti della relativa filiale lussemburghese rispetto a Citi US Equity ESG Focus Portfolio e Citi Global Equity ESG Focus Portfolio

Nessun obiettivo di investimento sostenibile

Questi prodotti finanziari promuovono caratteristiche ambientali o sociali, ma non hanno come obiettivo un investimento sostenibile.

Caratteristiche ambientali o sociali del prodotto finanziario

I prodotti finanziari promuovono il sostegno ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC) e mirano a evitare investimenti in determinate attività che potrebbero causare danni alla salute e al benessere dell'uomo applicando esclusioni vincolanti.

Strategia di investimento

Nell'ambito del processo di selezione degli investimenti si applicano i seguenti elementi ambientali, sociali e di governance (ESG) vincolanti, utilizzando i dati di fornitori di dati ESG esterni:

- (i) all'universo di investimento viene applicato uno screening ESG positivo al fine di garantire che gli investimenti presentino rating ESG positivi (come definiti dai nostri fornitori di dati ESG esterni); e
- (ii) vengono applicate le seguenti esclusioni: (a) società "non conformi" ai Principi UNGC o considerate come in violazione dei Principi dell'UNGC dai nostri fornitori di dati ESG esterni; (b) società che presentano un fatturato superiore al 10% (nel corso dell'esercizio precedente) derivante da determinate attività; e (c) società direttamente o indirettamente associate alla produzione o alla distribuzione di armi controverse e armi da fuoco civili.

Le prassi di buona governance delle società beneficiarie degli investimenti sono a loro volta considerate nell'ambito del processo di dovuta diligenza degli investimenti sulla base di una valutazione esterna dei dati ESG. Per ulteriori dettagli si rimanda all'informativa completa pubblicata sul sito web.

Quota degli investimenti

I prodotti finanziari si impegnano affinché una quota minima dell'80% degli investimenti soddisfi le caratteristiche promosse dai prodotti finanziari. La quota restante dell'investimento dei prodotti finanziari è costituita da liquidità e mezzi equivalenti, ivi compresi titoli emessi da fondi comuni monetari, detenuti ai fini di una gestione efficiente del portafoglio. I prodotti finanziari non intendono effettuare investimenti sostenibili e non tengono conto della tassonomia dell'UE e, pertanto, lo 0% dei prodotti finanziari è allineato alla tassonomia. Si prevede che la totalità dell'esposizione alle società beneficiarie degli investimenti sia diretta.

Monitoraggio delle caratteristiche ambientali o sociali

Le strategie di investimento dei prodotti finanziari vengono attuate attraverso un processo di investimento che aggiorna i punteggi ESG dei prodotti finanziari con cadenza annuale e, con cadenza mensile, aggiorna i dati di esclusione sulla base dei quali prendiamo le nostre decisioni di investimento. Ciò garantisce che gli investimenti utilizzati nell'ambito dei prodotti finanziari siano allineati agli elementi vincolanti utilizzati da questo prodotto al fine di promuovere caratteristiche ambientali o sociali.

Metodologie relative alle caratteristiche ambientali o sociali

L'Indice MSCI US (Citi US Equity ESG Focus Portfolio) e l'Indice MSCI World (Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) vengono utilizzati al fine di definire un universo di base applicabile ai prodotti finanziari interessati, ai quali si applicano screening positivi dei rating ESG e screening ESG di esclusione basati sui rating ESG e sui dati forniti da terze parti. I rating ESG sono determinati dal fornitore di dati tenendo conto della misura in cui una società è esposta a rischi ESG rilevanti e della relativa capacità di gestione della propria esposizione al rischio. I punti di rilevamento relativi agli screening di esclusione sono determinati dal fornitore di dati esterno in relazione alle attività della società. Per ulteriori dettagli si rimanda all'informativa completa pubblicata sul sito web.

Fonti e trattamento dei dati

Lo screening ESG positivo e le esclusioni ESG vengono applicati utilizzando i rating ESG e i dati forniti da Sustainalytics. I dati pertinenti sono accessibili tramite il sito web del fornitore o attraverso un feed di dati che riceviamo dal fornitore con cadenza mensile e vengono utilizzati nell'ambito del processo di investimento che consente di definire l'universo di investimento e di procedere a un monitoraggio periodico (vedi sopra). Poiché utilizziamo dati di terze parti per soddisfare le caratteristiche ambientali e sociali dei prodotti finanziari, non procediamo autonomamente alla valutazione dei dati. Sappiamo che Sustainalytics valuta una piccola quantità dei dati ESG che riceviamo a causa della mancanza di dati disponibili.

Limitazioni delle metodologie e dei dati

Sussistono delle problematiche generali associate ai dati ESG, che immaginiamo si applichino anche ai dati che riceviamo dal nostro fornitore di dati; tali problematiche includono (tra le altre) dati mancanti, ritardi in termini di tempistiche di segnalazione dei dati, metodologie divergenti tra i fornitori di dati e le fonti di dati per il calcolo o la stima dei dati e discrepanze tra i dati stimati e quelli segnalati. Poiché si tratta di limitazioni generali applicabili al mercato e non nello specifico ai prodotti finanziari o al nostro fornitore di dati, riteniamo di essere ancora in grado di soddisfare in modo adeguato le caratteristiche promosse dai prodotti finanziari. Vantiamo inoltre un processo interno di verifica e approvazione del fornitore che prevede l'analisi dell'approccio del fornitore di dati rispetto alla gestione dei dati, alla copertura dei dati e alle metodologie.

Dovuta diligenza

I potenziali investimenti saranno inclusi nei prodotti finanziari esclusivamente nel caso in cui siano conformi agli elementi ambientali, sociali e di governance (ESG) vincolanti sopra riepilogati e implementati nel processo di investimento quali filtri vincolanti. Inoltre, il nostro team di investimento dedicato ai criteri ESG procede costantemente a dibattiti interni relativi agli investimenti nei prodotti finanziari.

Politiche di impegno

L'impegno non costituisce direttamente parte integrante della strategia di investimento ambientale o sociale promossa dai prodotti finanziari. Le società beneficiarie degli investimenti non vantano procedure applicabili alle controversie legate alla sostenibilità. Ci impegniamo tuttavia con le società beneficiarie degli investimenti attraverso le nostre preferenze di voto per delega, le quali possono orientare i voti a questioni in linea con alcune tematiche di sostenibilità.

Indice di riferimento designato

I prodotti finanziari non hanno designato un indice di riferimento per il conseguimento delle relative caratteristiche ambientali o sociali.

Informazioni importanti

Per Citi Private Bank la riservatezza dei vostri dati è molto importante. Per ulteriori informazioni si rimanda al nostro sito web:

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

Citibank Europe plc, filiale di Lussemburgo, iscritta nel registro delle imprese del Lussemburgo con il numero B 200204, è una filiale di Citibank Europe plc. È soggetta alla supervisione congiunta della Banca centrale europea e della Banca centrale d'Irlanda. È inoltre soggetta alla vigilanza limitata della Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) in qualità di autorità dello Stato membro ospitante ed è iscritta alla CSSF con il numero B00000395. La relativa sede è ubicata presso 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Granducato di Lussemburgo.

Citibank Europe plc è regolamentata dalla Banca centrale d'Irlanda. È iscritta nel registro della Banca centrale con il numero di riferimento C26553 ed è sottoposta alla vigilanza della Banca centrale europea. La relativa sede legale è ubicata presso 1 North Wall Quay, Dublino 1, Irlanda. Citibank Europe plc è registrata in Irlanda con il numero di registrazione 132781. È regolamentata dalla Banca centrale d'Irlanda con il numero di riferimento C26553.

© 2022 Citigroup Inc. Tutti i diritti riservati. Citi e Citi with Arc Design sono marchi di servizio registrati di Citigroup o delle relative consociate.