

Citi Equity (US and Global) ESG Focus Portfolios

Sammanfattning av upplysningar på webbplatsen

Enligt förordningen om hållbarhetsrelaterade upplysningar ("SFDR") måste vi sammanfatta information som lämnas innan avtal ingås avseende en finansiell produkt som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper och viss annan information som publiceras på en webbplats. Dessa upplysningar lämnas för dessa ändamål av Citibank Europe plc, i förhållande till kunder i dess luxemburgska filial i förhållande till Citi US Equity ESG Focus Portfolio och Citi Global Equity ESG Focus Portfolio

Inget mål för hållbar investering

Dessa finansiella produkter främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper, men har inte hållbar investering som mål.

Den finansiella produktens miljörelaterade eller sociala egenskaper

De finansiella produkterna stödjer FN:s Global Compact-principer (UNGC) och strävar efter att undvika investeringar i vissa aktiviteter med potential att orsaka skador på människors hälsa och välbefinnande genom att tillämpa bindande utslutningar.

Investeringsstrategi

Följande bindande ESG-element (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning) tillämpas i urvalsprocessen för investeringar med hjälp av data från tredjepartsleverantörer av ESG-data:

- (i) en positiv ESG-granskning tillämpas på investeringsområdet för att säkerställa att investeringarna har goda ESG-betyg (enligt definitionen från våra tredjepartsleverantörer av ESG-data) och
- (ii) följande utslutningar tillämpas: (a) företag som inte efterlever UNGC-principerna eller betraktas som att de bryter mot UNGC av våra tredjepartsleverantörer av ESG-data, (b) företag som har större intäkter än 10 % (under företagets föregående räkenskapsår) från vissa aktiviteter; och (c) företag med direkt eller indirekt koppling till tillverkning eller distribution av kontroversiella vapen och civila skjutvapen.

Investeringsobjektens praxis för god styrning beaktas också i investeringsens due diligence-process baserat på ett ESG-betyg från tredje part. Mer information finns i de fullständiga upplysningarna på webbplatsen.

Andel av investeringarna

De finansiella produkterna åtar sig en minimiandel på 80 % av investeringarna för att uppnå de egenskaper som de finansiella produkterna främjar. Den återstående delen av investeringen i finansiella produkter består av kontanter och likvida medel, inklusive värdepapper som emitterats av penningmarknadsfonder, som innehåses för effektiv portföljförvaltning. De finansiella produkterna avser inte att göra några hållbara investeringar och beaktar inte EU-taxonomin och 0 % av de finansiella produkterna är taxonomianpassade. All exponering mot investeringsobjekt förväntas vara direkt.

Övervakning av miljörelaterade eller sociala egenskaper

De finansiella produkternas investeringsstrategier implementeras genom en investeringsprocess som uppdaterar de finansiella produkternas ESG-betyg varje år och, på månadsbasis, uppdaterar utslutningsdata som vi grundar våra investeringsbeslut på. Detta säkerställer att de investeringar som används i finansiella produkter är anpassade till de bindande delarna som tillämpas av denna produkt för att främja miljörelaterade eller sociala egenskaper.

Metoder för miljörelaterade eller sociala egenskaper

MSCI US Index (Citi US Equity ESG Focus Portfolio) och MSCI World Index (Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) används för att upprätta ett grundläggande område för de berörda finansiella produkterna, till vilka en positiv ESG-betygsgranskning och ESG-uteslutningsgranskning tillämpas baserat på ESG-betyg och -data från tredje part. ESG-betygen fastställs av dataleverantören genom att beakta i vilken utsträckning ett företag exponeras mot betydande ESG-risker och hur väl ett företag hanterar sin riskexponering. Datapunkterna för utslutningsgranskningen bestäms av tredjepartsdataleverantören med beaktande av företagets aktiviteter. Mer information finns i de fullständiga upplysningarna på webbplatsen.

Datakällor och behandling

Den positiva ESG-granskningen och ESG-uteslutningarna tillämpas med hjälp av ESG-betyg och -data som tillhandahålls av Sustainalytics. Relevanta data nås via leverantörens webbplats eller ett dataflöde som vi får från leverantören varje månad och används i investeringsprocessen, där investeringsområdet

definieras och för periodisk övervakning (se ovan). När vi använder data från tredje part för att uppfylla de ekonomiska produkternas miljörelaterade och sociala egenskaper uppskattar vi inte några data själva. Vi förstår att Sustainalytics uppskattar en liten mängd av de ESG-data som vi får på grund av bristen på tillgängliga data.

Begränsningar för metoder och data

Det finns allmänna utmaningar kopplade till ESG-data som vi förväntar oss gäller även de data vi använder från vår dataleverantör – dessa omfattar (bland annat) dataluckor, eftersläpande data när det gäller rapporteringstider, avvikande metoder mellan dataleverantörer och datakällor för beräkning eller uppskattning av data och avvikelser mellan uppskattade och rapporterade data. Eftersom det här är allmänna begränsningar på marknaden som inte är specifika för de finansiella produkterna eller vår valda dataleverantör, anser vi att vi fortfarande kan uppfylla de egenskaper som de finansiella produkterna främjar på ett lämpligt sätt. Vi upprätthåller också en intern leverantörsgranskning och godkännandeprocess som inbegriper granskning av dataleverantörens metod för datahantering, datatäckning och metoder.

Due diligence

Potentiella investeringar kommer endast att inkluderas i de finansiella produkterna om de uppfyller de bindande ESG-delarna (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning) som sammanfattas ovan, som implementeras i investeringsprocessen som bindande granskningar. Dessutom deltar vårt särskilda ESG-investeringssteam i pågående interna diskussioner om investeringarna i de finansiella produkterna.

Policyer för aktieägarengagemang

Engagemang är inte direkt en del av den miljörelaterade eller sociala investeringsstrategi som främjas av de finansiella produkterna. Vi har inga förfaranden som gäller hållbarhetsrelaterade kontroverser bland investeringsobjekt. Vi engagerar oss dock i investeringsobjekt via vår fullmaktsröstning, som kan styra röster till frågor knutna till vissa hållbarhetsämnen.

Valt referensvärde

De finansiella produkterna har inte valt något referensvärde för att uppnå sina miljörelaterade eller sociala egenskaper.

Viktig information

På Citi Private Bank tar vi din datasekretess på allvar. Mer information finns på vår webbplats:

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

Citibank Europe plc, Luxemburgfilialen, registrerad hos Luxembourg Trade and Companies Register med nummer B 200204, är en filial till Citibank Europe plc. Den står under gemensam tillsyn av den Europeiska centralbanken och Irlands centralbank. Banken lyder dessutom under begränsad reglering av Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) i sin roll som tillsynsmyndighet i mottagande medlemsstat och är registrerad hos CSSF med nummer B00000395. Dess kontoret ligger på 31 Z.A. Bourmicht, 8070 Berthof, Storchertigdomet Luxemburg.

Citibank Europe plc regleras av Irlands centralbank. Banken finns i centralbankens register med referensnummer C26553 och står under tillsyn av Europeiska centralbanken. Dess säte ligger på 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irland. Citibank Europe plc är registrerat i Irland med organisationsnummer 132781. Banken regleras av Irlands centralbank med referensnummer C26553.

© 2022 Citigroup Inc. Med ensamrätt. Citi och Citi med Arc Design är registrerade tjänstemärken som tillhör Citigroup eller dess närstående bolag.