

## Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolios

### Veebisaidi avalikustamise kokkuvõte

Finantsosalistele kestlikkust käsitleva teabe avaldamise määrus (SFDR) nõuab, et võtaksime kokku oma meie lepingueelses avalikustamises esitatud teabe keskkondlike ja/või sotsiaalseid omadusi edendava finantstoote kohta ja teatava muu meie veebisaidil avaldatud teabe. Citibank Europe plc avalikustab selle nendel eesmärkidel, seoses oma Luksemburgi haru klientidega ja seoses Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolio portfelliga.

#### **Puudub kestliku investeerimise eesmärk**

Need finantstooted edendavad keskkondlike või sotsiaalseid omadusi, aga nende investeerimiseesmärk ei ole kestlik investeerimine.

#### **Finantstoote keskkondlikud või sotsiaalsed omadused**

Finantstooted edendavad ÜRO globaalse kokkuleppe (UNGC) põhimõtete toetamist ja püüavad siduvate välistuste rakendamisega vältida investeringuid mõningatesse tegevustes, mis võivad kahjustada inimeste tervist ning heaolu.

#### **Investeerimisstrateegia**

Investeeringute valikuprotsessis rakendatakse järgmisi keskkonna-, sotsiaal- ja ühingujuhtimise (edaspidi: ESG) siduvaid elemente, kasutades kolmandast osalisest ESG andmepakkujate andmeid ja/või CIM-hindamist:

- (i) investeerimiskeskonnale rakendatakse negatiivset ESG sõelumist ebasoodsa ESG reitinguga investeeringute (nagu on määratletud meie kolmandast osalisest ESG andmepakkujad ja/või CIM-hindamine) välistamiseks; ja
- (ii) rakendatakse järgmisi välistamisi: (a) ettevõtteid, mis „ei järgi“ UNGC põhimõtteid või mida meie kolmandast osalisest ESG andmepakkujad ja/või CIM-hindamine peavad UNGC põhimõtete rikkujateks; (b) ettevõtteid, mille teatud tegevuste tulu (ettevõtte eelmisel majandusaastal) ületab 10%; ja (c) ettevõtteid, mis on otseselt või kaudselt seotud vaidlusaluste relvade tootmise või turustamisega.

CIM võib vajaduse järgi omapoolse hindamisega kolmandast osalisest andmepakkujate ESG hindamist täiendada. Meie põhjaliku sisemise kontrolli põhjal võime kaasata finantstootete positsioone, mis kolmandate osaliste andmete põhjal ei vasta ühelegi ülaltoodud siduvale elemendile juhul, kui kolmanda osalise andmed on meie arvates ebapiisavad, puudulikud või ebatäpsed ja kui ettevõtte vastab meie isikliku põhjaliku analüüsi alusel ülaltoodud siduvatele elementidele. Sarnast protsessi järgime ka kolmandast osalisest andmepakkujate poolt hõlmamata emitentide puhul. Samamoodi võime välistada positsioone, mis näivad vastavat ühele või mitmele ülaltoodud kriteeriumile, aga mille puhul me oma põhjalike analüüside või muude andmeallikate põhjal ei nõustu kolmandast osalisest andmepakkujatega.

Investeeringu objektiks olevate ettevõtete häid valitsemistavasid võetakse arvesse ka kolmanda osalise ESG andmereitingul ja/või CIM-hindamisel põhinevas investeerimishoolsuse protsessis. Lisateabe saamiseks vaadake veebisaidi täielikku avalikustamist.

#### **Investeeringute osakaal**

Finantstootetega edendatavate omaduste saavutamiseks kohustuvad finantstooted tegema minimaalselt 80% investeeringutest. Ülejäänud osa finantstootete investeeringust koosneb rahast ja raha ekvivalentidest, sh rahaturu investeerimisfondide emiteeritud väärtpaberitest, mida hoitakse portfelli tõhusa haldamise eesmärgil. Finantstooted ei kavatse teha kestlikke investeeringuid ega võta arvesse ELi taksonoomiat ning seetõttu on 0% finantstootetest taksonoomiaga kooskõlas. Eeldatakse, et kogu kokkupuude investeerimisobjekti ettevõtetega on otsene.

#### **Keskkondlike või sotsiaalsete omaduste seire**

Finantstootete investeerimisstrateegiaid rakendatakse investeerimisprotsessi kaudu, mis värskendab igal kuul finantstootete ESG skoori ja värskendab välistamisandmeid, mille põhjal me langetame oma investeerimisotsuseid. Seda täiendab CIMi tehtav hinnang. See tagab, et finantstootetes tehtud investeeringud on vastavuses siduvate elementidega, mida see toode kasutab keskkonna- või sotsiaalsete omaduste edendamiseks.

#### **Metoodika**

Investeerimisstrateegiat rakendatakse läbi investeerimisprotsessi, mis värskendab kord kuus ESG näitajaid ja uuendab välistusandmeid, mille põhjal me teeme oma investeerimisotsuseid. ESG reitingud määrab andmepakkuja, võttes arvesse, mil määral on ettevõtte avatud märkimisväärsetele ESG riskidele ja kui hästi ettevõtte oma riske juhib. Välistavate sõelumiste andmepunktid määrab kolmandast isikust andmeandja ettevõtte tegevust silmas pidades. CIM võib omapoolse hindamisega kolmandast osalisest andmepakkuja ESG hindamist vajadust mööda täiendada. Lisateabe saamiseks vaadake veebisaidi täielikku avalikustamist.

#### **Andmeallikad ja andmetöötlus**

Negatiivset ESG sõelumist ja ESG välistusi rakendatakse ESG reitingute ja Sustainalyticsi esitatud andmete alusel. Asjaomastele andmetele pääseb juurde teenusepakkuja veebisaidi või andmevoos kaudu, mida me teenusepakkujalt igal kuul saame ja mida kasutatakse investeerimisprotsessis, kus on määratletud investeerimiskeskond, ning perioodiliseks jälgimiseks (vt ülal). Kuna kasutame finantstoodete keskkondlike ja sotsiaalsete omaduste täitmiseks kolmandate osaliste andmeid, ei hinda me andmeid ise. Mõistame, et Sustainalytics hindab saadaolevate andmete puudumise tõttu väikest hulka ESG andmetest.

CIM võib kasutada ka muid avalikke allikaid, samuti välise vahendaja uuringuandmeid ja ettevõtte juhtkonnaga kohtumiste käigus kogutud teavet.

### **Metoodika ja andmete piirangud**

ESG andmetega on seotud üldised probleemid, mis loodetavasti kehtivad ka andmete puhul, mida saame oma andmepakkujalt – nende hulka kuuluvad (muu hulgas) andmelüngad, andmeviitused aruandlustähtaegade osas, erinevad metoodikad andmepakkujate ja andmeallikate vahel, erinev andmete arvutamine või hindamine ning hinnanguliste ja esitatud andmete lahknevused. Kuna tegemist on turu üldiste piirangutega, mis ei ole spetsiifilised finantstoodetele ega meie valitud andmepakkujale, leiame, et suudame siiski asjakohaselt vastata finantstoodete reklaamitavatele omadustele. Samuti haldame sisemist tarnija ülevaatamise ja heakskiitmise protsessi, mis hõlmab andmepakkuja lähenemisviisi andmete haldamisele, andmete katvust ja metoodika ülevaatamist.

Andmelünkade vähendamiseks võib CIM kolmandast osalisest andmepakkuja ESG hindamist enda omaga täiendada.

### **Hoolsuskohustus**

Võimalikud investeeringud kaasatakse finantstoodetesse vaid juhul, kui need vastavad ülalpool kokku võetud ESG elementidele, mida rakendatakse investeerimisprotsessis siduvate sõelumistena. Lisaks osaleb meie ESG-le pühendunud investeerimismeeskond jooksvates sisemistes aruteludes, mis on seotud finantstoodetesse investeerimisega.

### **Kaasamispoliitika**

Kaasamine ei ole otseselt osa finantstoodetega edendatavast keskkondlikust või sotsiaalsest investeerimisstrateegiast. Meil ei ole investeerimisobjektiks olevates ettevõtetes kestlikkusega seotud vaidlustele kohaldatavaid protseduure.

### **Määratud võrdlusalus**

Finantstoodetel ei ole oma keskkonna- või sotsiaalsete omaduste saavutamiseks ette nähtud võrdlusaluseid.

## **Tähtis teave**

Citi Private Bank võtab teie isikuandmete kaitset tõsiselt. Põhjalikumad teavet leiate meie veebisaidilt: <https://www.privatebank.citibank.com/privacy>

**Citibank Europe plc, Luksemburgi filiaal**, mis on kantud Luksemburgi äri- ja ettevõttereistrisse numbriga B 200204, on ettevõtte Citibank Europe plc filiaal ning selle üle teostavad ühist järelevalvet Euroopa Keskpank ja Iirimaa Keskpank. Veel kuulub ettevõtte finantssektori järelevalve komisjoni (CSSF) kui asukohaliikmesriigi ametiasutuse piiratud kohaldamisalasse ja on registreeritud CSSFis numbriga B00000395. Ettevõtte tegevuskoha aadress on 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Luksemburgi Suurhertsogiriik.

**Citibank Europe plc** tegevust reguleerib Iirimaa Keskpank. Ettevõtte on kantud Keskpannga registrisse viitenumbriga C26553 ja selle üle teostab järelevalvet Euroopa Keskpank. Ettevõtte tegevuskoha aadress on 1 North Wall Quay, Dublin 1, Iirimaa. Citibank Europe plc on registreeritud Iirimaa ettevõtja registreerimisnumbriga 132781. Ettevõtte tegevust reguleerib Iirimaa Keskpank viitenumbriga C26553.

© 2024 Citigroup Inc. Kõik õigused kaitstud. Citi and Citi ja Arc Design on ettevõtte Citigroup või selle sidusettevõtete registreeritud kaubamärgid.