

Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolio

A weboldali közzététel összefoglalója

A fenntarthatósággal kapcsolatos közzétételekről szóló rendelet (az „SFDR”) előírja, hogy a szerződéskötés előtti tájékoztatónkban összefoglaljuk a környezeti és/vagy társadalmi jellemzőket elősegítő pénzügyi termékekre vonatkozó információkat, valamint bizonyos egyéb, a weboldalon közzétett információkat. Ezt a közzétételt a Citibank Europe plc a luxemburgi fióktelepének ügyfelei vonatkozásában, a Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolio kapcsán erre a célra készítette.

Nincs fenntartható befektetési célkitűzés

Ezek a pénzügyi termékek előmozdítják a környezeti vagy társadalmi jellemzők érvényesülését, de nem rendelkeznek fenntartható befektetési célkitűzéssel.

A pénzügyi termék környezeti vagy társadalmi jellemzői

A pénzügyi termékek előmozdítják az ENSZ Globális Megállapodásának (UNGC) alapelveit, és kötelező érvényű kizárások alkalmazásával igyekeznek elkerülni bizonyos tevékenységekbe történő befektetéseket, amelyek potenciálisan károsíthatják az emberi egészséget és jólétet.

Befektetési stratégia

A befektetés kiválasztási folyamatában a következő kötelező környezeti, társadalmi és vállalatirányítási („ESG”) elemeket alkalmazzuk, harmadik fél ESG-adatszolgáltatók adatainak felhasználásával és/vagy a CIM értékelésével:

- (i) negatív ESG-szűrőt alkalmazunk a befektetési univerzumban a kedvezőtlen ESG-minősítést mutató befektetések kiküszöböléséhez (a harmadik fél ESG-adatszolgáltatóink és/vagy a CIM értékelése által meghatározottak szerint); és
- (ii) a következő kizárásokat alkalmazzuk: (a) olyan vállalatok, amelyek „nem felelnek meg” az UNGC alapelveinek, vagy harmadik fél ESG-adatszolgáltatóink és/vagy a CIM értékelése szerint megsértik az UNGC alapelveit; (b) olyan vállalatok, amelyek bizonyos tevékenységekből (a vállalat előző pénzügyi évében) több mint 10%-os bevétellel rendelkeznek; és (c) olyan vállalatok, amelyek közvetlen vagy közvetett kapcsolatban állnak különösen nagy kárt okozó fegyverek gyártásával vagy terjesztésével.

A CIM eseti jelleggel kiegészítheti a harmadik fél adatszolgáltató ESG-értékelését a sajátjával. Belső fundamentális felülvizsgálatunk alapján felvehetünk olyan pozíciókat a pénzügyi termékekben, amelyek a harmadik féltől származó adatok alapján látszólag nem felelnek meg a fenti kötelező elemek bármelyikének, amennyiben úgy véljük, hogy a harmadik féltől származó adatok elégtelenek, hiányosak vagy pontatlanok, és a saját fundamentális elemzésünk alapján a vállalat megfelel a fenti kötelező elemeknek. Hasonló eljárást követünk azon kibocsátók esetében, amelyeket nem fed le a harmadik fél adatszolgáltató. Hasonlóképpen kizárhatunk olyan pozíciókat, amelyek látszólag megfelelnek a fenti kritériumok közül egy vagy több feltételnek, de amelyek esetében a saját fundamentális elemzésünk vagy más adatforrások alapján nem értünk egyet a harmadik féltől származó adatokkal.

A befektetést fogadó vállalkozások jó irányítási gyakorlatát a befektetés átvilágítási folyamatának során is figyelembe vesszük, harmadik fél ESG-adatminősítése és/vagy a CIM értékelése alapján. További részletekért tekintse meg a teljes weboldali közzétételt.

A befektetések aránya

A pénzügyi termékek által támogatott jellemzők elérése érdekében a pénzügyi termékek a befektetések minimum 80%-át teszik ki. A pénzügyi termékek befektetésének fennmaradó részét a hatékony portfóliókezelés érdekében tartott pénzeszközök és pénzeszközökkel egyenértékű eszközök teszik ki, beleértve a pénzpiaci befektetési alapok által kibocsátott értékpapírokat. A pénzügyi termékek nem szándékoznak fenntartható befektetéseket megvalósítani, és nem veszik figyelembe az uniós taxonómiai rendeletet, így a pénzügyi termékek 0%-a áll összhangban a taxonómiai rendelettel. A befektetést fogadó vállalkozásokkal szembeni összes kitétség várhatóan közvetlen lesz.

Környezeti vagy társadalmi jellemzők monitorozása

A pénzügyi termékek befektetési stratégiái egy befektetési folyamaton keresztül valósulnak meg, amely havonta frissíti a pénzügyi termékek ESG-pontszámait, és havonta frissíti azokat a kizárásra vonatkozó adatokat, amelyek alapján befektetési döntéseinket meghozzuk. Ez kiegészül a CIM saját értékelésével. Ez biztosítja, hogy a pénzügyi termékekben alkalmazott befektetések összhangban legyenek a termék által a környezeti vagy társadalmi jellemzők előmozdítására használt kötelező elemekkel.

Módszertanok

A befektetési stratégia egy befektetési folyamaton keresztül valósul meg, amely havonta frissíti az ESG-pontszámokat, valamint azokat a kizárásra vonatkozó adatokat, amelyek alapján befektetési döntéseinket meghozzuk. Az ESG-minősítéseket az adatszolgáltató határozza meg annak figyelembevételével, hogy egy vállalat milyen mértékben van kitéve lényeges ESG-kockázatoknak, és mennyire jól kezeli a vállalat a kockázati kitétséget. A kizárások szűrők adatait a vállalat tevékenységének figyelembevételével a harmadik fél adatszolgáltató határozza meg. A CIM eseti jelleggel kiegészítheti a harmadik fél adatszolgáltató ESG-értékelését a sajátjával. További részletekért tekintse meg a teljes weboldali közzétételt.

Adatforrások és -feldolgozás

A negatív ESG-szűrő és az ESG-kizárások alkalmazása a Sustainalytics által biztosított ESG-minősítések és adatok alapján történik. A releváns adatok a szolgáltató weboldalán vagy a szolgáltatótól havonta kapott adatfolyamon keresztül érhetők el, és felhasználhatók abban a befektetési folyamatban, ahol a befektetési univerzumot meghatározzák, valamint időszakos monitorozásra (lásd fent). Mivel a pénzügyi termékek környezeti és társadalmi jellemzőinek való megfelelés érdekében harmadik fél adatait használjuk fel, mi magunk nem végzünk semmilyen adatbecslést. Tisztában vagyunk vele, hogy a Sustainalytics a rendelkezésre álló adatok hiánya miatt a hozzánk beérkező ESG-adatoknak csak egy kis részét értékeli.

A CIM más nyilvánosan elérhető forrásokat, valamint külső brókerek kutatásait és a vállalat vezetésével folytatott megbeszélések során gyűjtött információkat is felhasználhat.

A módszerekre és adatokra vonatkozó korlátozások

Az ESG-adatokkal kapcsolatban vannak olyan általános kihívások, amelyek várhatóan az adatszolgáltatóinktól származó adatokra is vonatkoznak – idetartoznak (többek között) az adathiányok, az adatok késése az adatszolgáltatási határidők tekintetében, az adatszolgáltatók és az adatforrások eltérő módszerei az adatok kiszámításához vagy becsléséhez, valamint a becslt és jelentett adatok közötti eltérések. Mivel ezek általános piaci korlátozások és nem kifejezetten a pénzügyi termékekre vagy a kiválasztott adatszolgáltatókra vonatkoznak, úgy gondoljuk, hogy továbbra is képesek vagyunk kellőképpen megfelelni a pénzügyi termékek által előmozdított jellemzőknek. Emellett egy szolgáltatókra vonatkozó felülvizsgálati és jóváhagyási belső folyamatot is fenntartunk, amely magában foglalja az adatszolgáltató adatkezelési megközelítésének, adatlefedettségének és módszertanának felülvizsgálatát.

Az esetleges adathiányok mérséklése érdekében a CIM kiegészítheti a harmadik fél adatszolgáltató ESG-értékelését a sajátjával.

Átvilágítás

A potenciális befektetések csak akkor kerülnek be a pénzügyi termékek közé, ha megfelelnek a fent összefoglalt kötelező környezeti, társadalmi és irányítási („ESG”) elemeknek, amelyeket a befektetési folyamatban kötelező szűrőként valósítanak meg. Emellett az ESG-kritériumokkal foglalkozó befektetési csapatunk folyamatos belső megbeszéléseket folytat a pénzügyi termékekbe történő befektetésekkel kapcsolatban.

Szerepvállalási politikák

A szerepvállalás közvetlenül nem része a pénzügyi termékek által előmozdított környezeti vagy társadalmi befektetési stratégiának. Nem rendelkezünk olyan eljárásokkal, amelyek a fenntarthatósággal kapcsolatos vitákban alkalmazhatók lennének a befektetést fogadó vállalkozásoknál.

Kijelölt referenciaérték

A pénzügyi termékek nem jelöltek ki referenciaértéket a környezeti vagy társadalmi jellemzőik elérésének érdekében.

Fontos információk

A Citi Private Banknál komolyan vesszük az Ön adatainak védelmét. További információért látogasson el weboldalunkra: <https://www.privatebank.citibank.com/privacy>

A luxemburgi kereskedelmi és cégnyilvántartásban B 200204 számon bejegyzett **Citibank Europe plc, Luxembourg Branch** a Citibank Europe plc fióktelepe. Az Európai Központi Bank és az Írországi Központi Bank közös felügyelete alá tartozik. Ezenkívül a fogadó tagállam hatóságaként a Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) korlátozott szabályozása alá tartozik, és a CSSF-nél a B00000395 számon van bejegyezve. Irodájának címe: 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Luxemburgi Nagyhercegség

A **Citibank Europe plc** az Írországi Központi Bank szabályozása alá tartozik. A Központi Bank nyilvántartásában C26553 hivatkozási számmal szerepel, és az Európai Központi Bank felügyeli. Székhelyének címe: 1 North Wall Quay, Dublin 1, Írország. A Citibank Europe plc Írországban van bejegyezve, cégjegyzékszáma: 132781. Az Írországi Központi Bank szabályozása alá tartozik, hivatkozási száma: C26553.

© 2024 Citigroup Inc. Minden jog fenntartva. A Citi és a Citi with Arc Design a Citigroup vagy leányvállalatai bejegyzett szolgáltatásvédjegyei.