

## Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolio

### Podsumowanie dotyczące ujawniania informacji na stronie internetowej

Rozporządzenie w sprawie ujawniania informacji związanych ze zrównoważonym rozwojem w sektorze usług finansowych („SFDR”) wymaga od nas podsumowania informacji podanych w ujawnieniu przed zawarciem umowy w odniesieniu do produktu finansowego, który promuje aspekty środowiskowe i/lub społeczne oraz pewnych innych informacji publikowanych na stronie internetowej. Niniejsze ujawnienie jest dokonywane w powyższych celach przez spółkę Citibank Europe plc, w odniesieniu do klientów jej oddziału w Luksemburgu w związku z Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolio.

#### **Brak celu dotyczącego zrównoważonych inwestycji**

Produkty finansowe promują aspekty środowiskowe lub społeczne, ale ich celem nie jest zrównoważona inwestycja.

#### **Aspekty środowiskowe lub społeczne produktu finansowego**

Produkty finansowe promują wsparcie dla zasad inicjatywy Global Compact ONZ (UNGC) i unikanie inwestycji w niektóre działania stanowiące potencjalne zagrożenie dla ludzkiego zdrowia i dobrostanu poprzez stosowanie wiążących wykluczeń.

#### **Strategia inwestycyjna**

W procesie wyboru inwestycji przy użyciu danych od zewnętrznych dostawców danych ESG i/lub oceny CIM stosuje się następujące wiążące elementy z zakresu ochrony środowiska, polityki społecznej i ładu korporacyjnego („ESG”):

- (i) do zakresu inwestycyjnego zostaje zastosowany negatywny obraz ESG w celu wyeliminowania inwestycji, które wykazują niekorzystne ratingi ESG (zgodnie z definicją naszych zewnętrznych dostawców danych ESG i/lub oceną CIM); oraz
- (ii) stosuje się następujące wykluczenia: (a) spółki, które są „niezgodne” z zasadami UNGC lub zostały uznane za naruszające zasady UNGC przez naszych zewnętrznych dostawców danych ESG i/lub w ramach oceny CIM; (b) spółki, w przypadku których ponad 10% przychodów (w poprzednim roku podatkowym spółki) pochodzi z określonej działalności; oraz (c) spółki bezpośrednio lub pośrednio powiązane z produkcją lub dystrybucją kontrowersyjnych rodzajów broni.

CIM może doraźnie uzupełnić ocenę ESG zewnętrznego dostawcy danych o własną ocenę. W oparciu o naszą wewnętrzną analizę fundamentalną możemy uwzględnić pozycje w produktach finansowych, które, jak wynika z danych stron trzecich, wydają się nie spełniać dowolnego z powyższych elementów wiążących, w przypadku gdy uznamy, że dane stron trzecich są niewystarczające, niekompletne lub niedokładne, a nasza analiza fundamentalna wskazuje, że spółka spełnia powyższe elementy wiążące. Podobny proces stosujemy w przypadku emitentów, których nie obejmuje zewnętrzny dostawca danych. Na podobnej zasadzie możemy wykluczyć pozycje, które wydają się spełniać jedno lub więcej z powyższych kryteriów, ale w przypadku których nie zgadzamy się z danymi stron trzecich w oparciu o naszą analizę fundamentalną lub inne źródła danych.

Dobre praktyki w zakresie zarządzania spółek, w które dokonano inwestycji, są również uwzględniane w procesie due diligence inwestycji w oparciu o ocenę danych ESG stron trzecich i/lub ocenę CIM. Więcej informacji można znaleźć w pełnym ujawnieniu informacji na stronie internetowej.

#### **Udział inwestycji**

Produkty finansowe zobowiązują się do minimalnego udziału 80% inwestycji w celu uwzględnienia aspektów promowanych przez produkty finansowe. Pozostała część inwestycji w produkty finansowe składa się ze środków pieniężnych i ich ekwiwalentów, w tym papierów wartościowych emitowanych przez fundusze wzajemne rynku pieniężnego, utrzymywanych w celu efektywnego zarządzania portfelem. Produkty finansowe nie mają na celu dokonywania żadnych zrównoważonych inwestycji i nie uwzględniają unijnej systematyki, w związku z czym zgodnie z systematyką jest 0% produktów finansowych. Oczekuje się, że cała ekspozycja na spółki, w które dokonano inwestycji, będzie bezpośrednia.

#### **Monitorowanie aspektów środowiskowych lub społecznych**

Strategie inwestycyjne produktów finansowych są wdrażane w ramach procesu inwestycyjnego, który co miesiąc aktualizuje wyniki ESG produktów finansowych oraz, co miesiąc, dane dotyczące wykluczeń, na podstawie których podejmujemy decyzje inwestycyjne. Jest to uzupełniane przez ocenę własną CIM. Dzięki temu inwestycje wykorzystywane w produktach finansowych są dostosowane do wiążących elementów stosowanych przez produkt do promowania aspektów środowiskowych lub społecznych.

#### **Metody**

Strategia inwestycyjna jest wdrażana w ramach procesu inwestycyjnego, który co miesiąc aktualizuje wyniki ESG oraz dane dotyczące wykluczeń, na podstawie których podejmujemy decyzje inwestycyjne. Ratingi ESG są określane przez dostawcę danych z uwzględnieniem stopnia, w jakim spółka jest narażona na istotne ryzyka ESG oraz tego, jak dobrze spółka zarządza swoją ekspozycją na ryzyko. Punkty danych dla obrazów wykluczających są określane przez zewnętrznego dostawcę danych poprzez odniesienie do działalności spółki. CIM może doraźnie uzupełnić ocenę ESG zewnętrznego dostawcy danych o własną ocenę. Więcej informacji można znaleźć w pełnym ujawnieniu informacji na stronie internetowej.

### **Źródła i przetwarzanie danych**

Negatywny obraz ESG i wykluczenia ESG są stosowane przy użyciu ratingów i danych ESG dostarczanych przez Sustainalytics. Odpowiednie dane dostępne są na stronie internetowej dostawcy lub za pomocą źródła danych, które otrzymujemy od dostawcy co miesiąc, i wykorzystywane w procesie inwestycyjnym, gdzie definiowany jest zakres inwestycyjny oraz do okresowego monitorowania (patrz wyżej). Ponieważ wykorzystujemy dane podmiotów zewnętrznych, aby uwzględnić środowiskowe i społeczne aspekty produktów finansowych, sami nie szacujemy żadnych danych. Rozumiemy, że z uwagi na niedostępność danych niewielka ilość przekazywanych nam danych ESG jest przez Sustainalytics szacowana.

CIM może również korzystać z innych publicznie dostępnych zasobów, a także badań zewnętrznych brokerów i informacji zebranych podczas spotkań z kierownictwem spółki.

### **Ograniczenia dotyczące metod i danych**

Istnieją ogólne wyzwania związane z danymi ESG, które naszym zdaniem mają również zastosowanie do danych pozyskiwanych od naszego dostawcy danych – obejmują one (między innymi) luki w danych, opóźnienia w raportowaniu danych, rozbieżności w zakresie metod różnych dostawców danych i źródeł danych związane z obliczaniem lub szacowaniem danych oraz rozbieżności między danymi szacunkowymi a raportowanymi. Ponieważ są to ogólne ograniczenia występujące na rynku, które nie są specyficzne dla produktów finansowych lub wybranego przez nas dostawcy danych, uważamy, że nadal jesteśmy w stanie należycie uwzględnić aspekty promowane przez produkty finansowe. Prowadzimy również wewnętrzny proces weryfikacji i zatwierdzania dostawców, który obejmuje przegląd podejścia dostawcy danych do zarządzania danymi, zakresu danych i metod.

CIM może uzupełnić ocenę ESG przeprowadzoną przez zewnętrznego dostawcę danych o własną ocenę w celu ograniczenia luk w danych.

### **Due diligence**

Potencjalne inwestycje zostaną włączone do produktów finansowych tylko w przypadku, gdy będą zgodne z wiążącymi elementami ESG podsumowanymi powyżej, które są wdrażane w procesie inwestycyjnym jako siatki powiązań. Ponadto nasz zespół ds. inwestycji dedykowany ESG angażuje się w bieżące wewnętrzne rozmowy związane z inwestycjami w produkty finansowe.

### **Polityka dotycząca zaangażowania**

Zaangażowanie nie jest bezpośrednio częścią środowiskowej lub społecznej strategii inwestycyjnej promowanej przez produkty finansowe. Nie posiadamy żadnych procedur mających zastosowanie do kontrowersji związanych ze zrównoważonym rozwojem w spółkach, w które dokonano inwestycji.

### **Wyznaczony wskaźnik referencyjny**

Produkty finansowe nie wyznaczyły wskaźnika referencyjnego w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych.

## **Ważne informacje**

W Citi Private Bank poważnie traktujemy prywatność danych. Więcej informacji można znaleźć na naszej stronie internetowej:  
<https://www.privatebank.citibank.com/privacy>

Spółka **Citibank Europe plc, oddział w Luksemburgu**, zarejestrowana w luksemburskim rejestrze handlowym i spółek pod numerem B 200204, jest oddziałem Citibank Europe plc. Podlega wspólnemu nadzorowi Europejskiego Banku Centralnego i Banku Centralnego Irlandii. Ponadto podlega ograniczonym regulacjom ze strony Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) w roli organu przyjmującego państwa członkowskiego i jest zarejestrowana w CSSF pod numerem B00000395. Siedziba spółki znajduje się pod adresem 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Wielkie Księstwo Luksemburga.

Działalność **Citibank Europe plc** jest regulowana przez Bank Centralny Irlandii. Widnieje w rejestrze Banku Centralnego pod numerem referencyjnym C26553 i jest nadzorowana przez Europejski Bank Centralny. Siedziba spółki znajduje się pod adresem 1 North Wall Quay, Dublin 1, Ireland. Spółka Citibank Europe plc jest zarejestrowana w Irlandii pod numerem 132781. Jej działalność jest regulowana przez Bank Centralny Irlandii pod numerem referencyjnym C26553.

© 2024 Citigroup Inc. Wszelkie prawa zastrzeżone. Citi i Citi with Arc Design są zarejestrowanymi znakami usługowymi grupy Citigroup lub jej spółek zależnych.