

Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolio

Zhrnutie zverejnených informácií uvedených na webových lokalitách

Nariadenie o zverejňovaní informácií o udržateľnom financovaní („SFDR“) vyžaduje, aby sme zhrnuli informácie uvedené v predzmluvných informáciách o finančnom produkte, ktorý podporuje environmentálne a/alebo sociálne vlastnosti a niektoré ďalšie informácie zverejnené na internetovej lokalite. Toto vyhlásenie za týmto účelom vykonáva Citibank Europe plc, s ohľadom na klientov svojej Luxemburskej pobočky v súvislosti s portfóliom Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolio.

Žiadny cieľ v oblasti udržateľných investícií

Tieto finančné produkty podporujú environmentálne alebo sociálne vlastnosti, ale ich investičným cieľom nie je udržateľné investovanie.

Environmentálne alebo sociálne vlastnosti finančného produktu

Finančné produkty sa tiež snažia podporovať zásady UN Global Compact (UNGC) a snažia sa vyhnúť investíciám do určitých činností, ktoré by mohli spôsobiť škody na ľudskom zdraví a blahu, uplatňovaním záväzných výnimiek.

Investičná stratégia

Pri procese výberu investícií sa uplatňujú tieto záväzné environmentálne a sociálne prvky a prvky správy a riadenia spoločností („ESG“) s použitím údajov ESG od poskytovateľov tretích strán a/alebo hodnotenia CIM:

- (i) na investičné prostredie sa uplatňuje negatívna kontrola ESG s cieľom vylúčiť investície, ktoré vykazujú nepriaznivé hodnotenia ESG (podľa definície našich poskytovateľov údajov ESG tretích strán a/alebo hodnotenia CIM); a
- (ii) uplatňujú sa nasledujúce výnimky: (a) spoločnosti, ktoré „nedodržiavajú“ zásady UNGC alebo sú našimi poskytovateľmi údajov ESG tretích strán a/alebo hodnotením CIM považované za spoločnosti, ktoré porušujú zásady UNGC; (b) spoločnosti, ktoré majú viac ako 10 % príjmov (v predchádzajúcom finančnom roku spoločnosti) z určitých činností; a (c) spoločnosti, ktoré sú priamo alebo nepriamo spojené s výrobou alebo distribúciou kontroverzných zbraní.

CIM môže ad hoc doplniť hodnotenie ESG od poskytovateľa údajov tretích strán vlastným hodnotením. Na základe nášho interného základného preskúmania môžeme zahrnúť pozície vo finančných produktoch, ktoré sa na základe údajov tretích strán javia ako nespĺňajúce niektorý z vyššie uvedených záväzných prvkov, ak sa domnievame, že údaje tretích strán sú nedostatočné, neúplné alebo nepresné, a na základe našej vlastnej základnej analýzy je spoločnosť v súlade s vyššie uvedenými záväznými prvkami. Podobný postup uplatňujeme aj v prípade emitentov, na ktorých sa nevzťahuje poskytovateľ údajov tretej strany. Takisto môžeme vylúčiť pozície, ktoré zjavne spĺňajú jedno alebo viacero vyššie uvedených kritérií, no nesúhlasíme s údajmi tretích strán na základe vlastnej fundamentálnej analýzy alebo iných zdrojov údajov.

Postupy riadnej správy a riadenia spoločností, do ktorých sa investuje, sa rovnako zohľadňujú v procese kontroly investícií na základe hodnotenia údajov ESG treťou stranou a/alebo hodnotenia CIM. Podrobnejšie informácie nájdete v úplnej verzii vyhlásenia na webových lokalitách.

Pomer investícií

Finančné produkty sa zaväzujú k minimálnemu podielu 80 % investícií na dosiahnutie vlastností, ktoré finančné produkty podporujú. Zostávajúcu časť investícií finančných produktov tvorí hotovosť a peňažné ekvivalenty vrátane cenných papierov emitovaných podielovými fondmi peňažného trhu, držaných na účely efektívnej správy portfólia. Finančné produkty nemajú v úmysle vykonávať žiadne udržateľné investície a nezohľadňujú taxonómiu EÚ, a preto je 0 % finančných produktov v súlade s taxonómiou. Predpokladá sa, že celá expozícia voči spoločnostiam, do ktorých sa investuje, bude priama.

Sledovanie environmentálnych alebo sociálnych vlastností

Investičné stratégie finančných produktov sa realizujú prostredníctvom investičného postupu, v rámci ktorého sa každý mesiac aktualizuje skóre ESG finančných produktov a údaje o vylúčení, na základe ktorých prijímame investičné rozhodnutia. To je doplnené o vlastné hodnotenie CIM. Tým sa zabezpečí, že investície použité vo finančných produktoch sú v súlade so záväznými prvkami, ktoré tento produkt používa na podporu environmentálnych alebo sociálnych vlastností.

Metodiky

Investičná stratégia sa realizuje prostredníctvom investičného postupu, ktorý každý mesiac obnovuje skóre ESG a aktualizuje údaje o vylúčení, na základe ktorých prijímame investičné rozhodnutia. Hodnotenia ESG určuje poskytovateľ údajov s ohľadom na rozsah, v akom je spoločnosť vystavená významným rizikám ESG, a na to, ako dobre spoločnosť riadi svoje expozície voči rizikám. Údaje v rámci vylučovacích preverovaní určuje poskytovateľ údajov tretej strany, a to vzhľadom na činnosti spoločnosti. CIM môže ad hoc doplniť hodnotenie ESG od poskytovateľa údajov tretej strany vlastným hodnotením. Podrobnejšie informácie nájdete v úplnej verzii vyhlásenia na webových lokalitách.

