

Citi Global Transformation Portfolio

Résumé de la publication d'informations sur le site Internet

Le Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (Règlement SFDR) exige que nous résumions les informations fournies dans nos informations précontractuelles publiées concernant un produit financier qui promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales, ainsi que certaines autres informations publiées sur un site Internet. La présente publication d'informations est faite à ces fins par Citibank Europe plc concernant les clients de sa succursale luxembourgeoise vis-à-vis du Citi Global Transformation Portfolio

Aucun objectif d'investissement durable

Ces produits financiers promeuvent des caractéristiques environnementales ou sociales, mais l'investissement durable n'est pas leur objectif d'investissement.

Caractéristiques environnementales ou sociales du produit financier

Les produits financiers contribuent positivement à la mise en œuvre des Objectifs de développement durable (ODD) des Nations Unies en investissant dans des sociétés qui ont une exposition significative à un ou plusieurs thèmes de développement durable sélectionnés par nous (thèmes GTP de Citi, ou Citi Sustainable Multi-Thematic) qui sont alignés sur un ou plusieurs ODD des Nations Unies. Les produits financiers promeuvent également à appuyer les principes du Pacte mondial des Nations Unies et à éviter les investissements dans certaines activités susceptibles de nuire à la santé et au bien-être humains en appliquant des exclusions contraignantes.

Stratégie d'investissement

Les éléments ESG contraignants suivants sont appliqués dans le processus de sélection des investissements :

(i) Nous utilisons un filtre positif pour n'investir que dans des sociétés mondiales cotées en bourse dont au moins 30 % du chiffre d'affaires du dernier exercice clos porte sur un ou plusieurs thèmes GTP de Citi. Les entreprises qui n'atteignent pas ce seuil, mais pour lesquelles nous sommes suffisamment convaincus qu'elles pourraient l'atteindre dans les trois ans, sont susceptibles d'être incluses ; les entreprises incluses sur la base de ce critère peuvent constituer jusqu'à 20 % de la valeur des produits financiers ; et

(ii) Nous utilisons un filtre négatif basé sur des données de tiers pour exclure : (a) les entreprises qui tirent un quelconque revenu de la production, de la vente et/ou du transfert de mines terrestres antipersonnel ou de bombes à fragmentation, ou de la production et/ou de la fabrication de tabac ; (b) les entreprises considérées comme des contrevenants au Pacte mondial des Nations Unies.

Les bonnes pratiques de gouvernance des sociétés bénéficiaires des investissements sont également prises en compte dans le processus de diligence raisonnable des investissements reposant sur une notation de données ESG réalisée par un fournisseur tiers. Veuillez consulter l'intégralité de la publication d'informations sur le site Internet pour en savoir plus.

Proportion des investissements

Les produits financiers s'engagent à atteindre une proportion minimale de 80 % des investissements pour atteindre les caractéristiques promues par ceux-ci. La part restante des investissements des produits financiers peut comprendre des liquidités et des équivalents de liquidités, y compris des titres émis par des fonds communs de placement monétaires, détenus à des fins de gestion efficace de portefeuille. Les produits financiers n'ont pas pour objectif de réaliser des investissements durables et ne tiennent pas compte du Règlement européen sur la taxonomie et, à ce titre, aucun des produits financiers n'est aligné sur ledit règlement. Toute exposition aux sociétés bénéficiaires des investissements devrait être directe.

Suivi des caractéristiques environnementales ou sociales

Les investissements potentiels seront inclus dans les produits financiers uniquement s'ils sont conformes aux éléments ESG contraignants résumés ci-dessus. Les données utilisées pour mesurer les expositions aux revenus sont mises à jour annuellement, et celles pour les exclusions sont mises à jour sur une base trimestrielle.

Méthodologies relatives aux caractéristiques environnementales ou sociales

L'univers d'investissement des produits financiers est initialement réduit par des filtres positifs, afin d'inclure des sociétés mondiales cotées en bourse dont au moins 30 % du chiffre d'affaires du dernier exercice clos porte sur un ou plusieurs thèmes GTP de Citi. Les entreprises qui n'atteignent pas ce seuil, mais pour lesquelles nous sommes suffisamment convaincus qu'elles pourraient l'atteindre dans les trois ans, sont susceptibles d'être incluses ; les entreprises incluses sur la base de ce critère peuvent constituer jusqu'à 20 % des produits financiers.

Les données de tiers sont utilisées pour appliquer un filtre négatif afin de mieux définir l'univers d'investissement. Nous appliquons une exclusion basée sur les revenus, conformément au Pacte mondial des Nations Unies, afin d'exclure les entreprises qui tirent un quelconque revenu de la production, de la vente et/ou du transfert de mines terrestres antipersonnel ou de bombes à fragmentation, ou de la production et/ou de la fabrication de tabac.

Nous appliquons également un filtre négatif afin d'exclure les entreprises considérées comme des contrevenants au Pacte mondial des Nations Unies. La méthodologie du fournisseur de données tiers est subjective et nous pouvons la considérer comme incomplète. Nous débattons et examinerons également des entreprises spécifiques que nous avons identifiées comme étant conformes au Pacte mondial des Nations unies, malgré l'opinion subjective du fournisseur de données tiers qui a conduit à une note « non conforme », et nous pourrions les considérer à des fins d'investissement. Les exceptions sur la base de ce critère peuvent constituer jusqu'à 20 % du portefeuille. Veuillez consulter l'intégralité de la publication d'informations sur le site Internet pour en savoir plus.

Sources et traitement des données

L'attribution des revenus aux thèmes GTP de Citi est évaluée selon les informations publiées directement par les entreprises publiques. Ces données proviennent directement des entreprises, ou de Bloomberg et/ou Factset. Dans la mesure où ces informations seront basées sur des informations publiées par les entreprises, nous ne nous attendons pas à ce qu'elles fassent l'objet d'une estimation. Les exclusions sont appliquées selon les données fournies par Sustainalytics. Les données pertinentes sont accessibles par la plateforme du fournisseur ou via une source de données que nous recevons chaque mois du fournisseur et utilisées dans les étapes initiales du processus d'investissement, où l'univers d'investissement est défini, et à des fins de suivi périodique (voir ci-dessus). Nous comprenons que Sustainalytics procède à une estimation de certaines données ESG que nous recevons en raison du manque de données disponibles.

Limites des méthodologies et des données

Des défis d'ordre général sont associés aux données ESG et, selon nous, s'appliquent également aux données que nous exploitons de nos fournisseurs de données et depuis les marchés. Il s'agit notamment des écarts de données, des retards de données sur le calendrier de reporting, des divergences de méthodologies entre les fournisseurs de données et les sources de données pour le calcul ou l'estimation des données et des écarts entre les données estimées et celles déclarées. Dans la mesure où il s'agit de limites générales du marché qui ne sont pas spécifiques aux produits financiers ou aux fournisseurs de données que nous avons sélectionnés, nous considérons que nous sommes toujours en mesure de répondre de manière appropriée aux caractéristiques promues par les produits financiers. Nous maintenons également un processus interne d'examen et d'approbation des fournisseurs qui implique de revoir l'approche du fournisseur de données en matière de gestion des données, de couverture des données et de méthodologies.

Diligence raisonnable

Les investissements potentiels seront inclus dans les produits financiers uniquement s'ils sont conformes aux éléments ESG contraignants résumés ci-dessus, lesquels sont mis en œuvre dans le processus d'investissement en tant que filtres contraignants. En outre, notre équipe d'investissement dédiée aux facteurs ESG participe à des discussions internes continues portant sur les investissements dans les produits financiers.

Politiques d'engagement

L'engagement ne fait pas directement partie de la stratégie d'investissement environnementale ou sociale promue par les produits financiers. Nous n'avons pas de procédures applicables aux controverses liées à la durabilité des sociétés bénéficiaires des investissements. Toutefois, nous nous engageons auprès des sociétés bénéficiaires des investissements par le biais de nos préférences de vote par procuration, qui peuvent orienter les votes vers des questions liées à certaines questions de durabilité.

Indice de référence désigné

Il n'a pas été désigné d'indice de référence pour les produits financiers en vue de satisfaire à leurs caractéristiques environnementales ou sociales.

Informations importantes

Chez Citi Private Bank, nous prenons la confidentialité de vos données au sérieux. Pour en savoir plus, rendez-vous sur notre site Web :

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

Citibank Europe plc, succursale de Luxembourg, immatriculée au Registre du Commerce et des sociétés de Luxembourg sous le numéro B 200204, est une succursale de Citibank Europe plc. Elle est soumise à la supervision conjointe de la Banque centrale européenne et de la Banque centrale d'Irlande. Elle est par ailleurs soumise à une réglementation limitée de la Commission de surveillance du secteur financier (la CSSF) dans le cadre de ses fonctions d'autorité d'un État membre d'accueil et enregistrée auprès de la CSSF sous le numéro B00000395. Son bureau est sis 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Grand-Duché de Luxembourg.

Citibank Europe plc est réglementée par la Banque centrale d'Irlande. Elle apparaît sur le registre de la Banque centrale sous le numéro de référence C26553 et est supervisée par la Banque centrale européenne. Son siège social est sis 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irlande. Citibank Europe plc est enregistrée en Irlande sous le numéro de registre 132781. Elle est réglementée par la Banque centrale d'Irlande sous le numéro de référence C26553.

© 2023 Citigroup Inc. Tous droits réservés. Citi et Citi with Arc Design sont des marques de service déposées de Citigroup ou de ses sociétés affiliées.