

Citi Global Transformation Portfolio

Sintesi dell'informativa del sito Web

Il regolamento sull'Informativa di sostenibilità dei servizi finanziari (SFDR) prescrive di riassumere le informazioni fornite nella nostra informativa precontrattuale relativamente a un prodotto finanziario che promuove le caratteristiche ambientali e/o sociali e alcune altre informazioni pubblicate su un sito Web. A tale scopo, Citibank Europe plc, in relazione ai clienti della propria filiale lussemburghese, ha fornito tale informativa in merito al Citi Global Transformation Portfolio

Nessun obiettivo di investimento sostenibile

Tali prodotti finanziari promuovono caratteristiche ambientali o sociali, ma non hanno come obiettivo d'investimento un investimento sostenibile.

Caratteristiche ambientali o sociali del prodotto finanziario

I prodotti finanziari promuovono un apporto positivo all'evoluzione degli obiettivi di sviluppo sostenibile delle Nazioni Unite (UN SDG), investendo in società che hanno un'esposizione significativa a uno o più temi di sostenibilità da noi selezionati (Temi Citi GTP) allineati a uno o più SDG delle Nazioni Unite. I prodotti finanziari mirano inoltre a sostenere i Principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC) ed evitare investimenti in determinate attività potenzialmente pericolose per la salute e il benessere dell'uomo, applicando esclusioni vincolanti.

Strategia d'investimento

Nel processo di selezione degli investimenti vengono applicati i seguenti elementi ESG vincolanti:

- (i) utilizziamo uno screening positivo per investire esclusivamente in società quotate a livello globale con un fatturato minimo del 30% nell'ultimo esercizio finanziario completato, attribuito a uno o più temi Citi GTP. Tutte le imprese che non soddisfano questa soglia, ma laddove siamo sufficientemente convinti che possano raggiungerla entro tre anni, possono essere prese in considerazione per l'inclusione; le imprese incluse sulla base di questo criterio possono rappresentare fino al 20% del valore dei prodotti finanziari; e
- (ii) a fini di esclusione, utilizziamo uno screening negativo basato su dati di terze parti: (a) imprese che ottengono ricavi dalla produzione, vendita e/o trasporto di mine antiuomo o bombe a grappolo o dalla produzione e/o lavorazione di tabacco, (b) imprese che violano i Principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC).

Sulla base di una valutazione dei dati ESG di terze parti, vengono inoltre prese in considerazione nel processo di due diligence degli investimenti le prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti. Per ulteriori dettagli, si rimanda all'informativa completa sul sito Web.

Quota degli investimenti

I prodotti finanziari si impegnano a una quota minima di investimenti pari all'80% per conseguire le caratteristiche promosse dai prodotti finanziari. La parte restante dell'investimento dei prodotti finanziari può comprendere disponibilità liquide o mezzi equivalenti, compresi strumenti finanziari emessi da fondi comuni di investimento del mercato monetario, detenuti ai fini di una gestione efficiente del portafoglio. I prodotti finanziari non intendono effettuare investimenti sostenibili e non tengono conto della tassonomia dell'UE e, pertanto, lo 0% dei prodotti finanziari è allineato alla tassonomia. Si prevede che tutta l'esposizione alle imprese beneficiarie degli investimenti sia diretta.

Monitoraggio delle caratteristiche ambientali o sociali

I potenziali investimenti saranno inclusi nei prodotti finanziari solamente se conformi agli elementi ESG vincolanti riassunti in precedenza. I dati utilizzati ai fini della valutazione delle esposizioni ai ricavi vengono aggiornati con frequenza annuale e quelli relativi alle esclusioni vengono aggiornati con frequenza trimestrale.

Metodologie relative alle caratteristiche ambientali o sociali

L'universo d'investimento dei prodotti finanziari viene inizialmente filtrato utilizzando screening positivi, al fine di includere società globali quotate in borsa con un minimo del 30% di ricavi, per l'ultimo esercizio finanziario completato, attribuito a uno o più temi Citi GTP. Tutte le imprese che non soddisfano questa soglia, ma laddove siamo sufficientemente convinti che possano raggiungerla entro tre anni, possono essere prese in considerazione per l'inclusione; le imprese incluse in base a questo criterio possono rappresentare fino al 20% dei prodotti finanziari.

I dati di terzi vengono utilizzati per applicare uno screening negativo al fine di definire ulteriormente l'universo d'investimento. Applichiamo un'esclusione basata sui ricavi, in linea con i Principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC), per escludere le imprese che generano ricavi dalla produzione, vendita e/o trasporto di mine antiuomo o bombe a grappolo o dalla produzione e/o lavorazione di tabacco.

Applichiamo inoltre degli screening negativi per escludere le imprese che violano i Principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC). La metodologia dei fornitori terzi di dati è soggettiva e possiamo ritenerla incompleta. Inoltre, tratteremo ed esamineremo imprese che abbiamo contrassegnato come conformi al Global Compact delle Nazioni Unite, nonostante l'opinione soggettiva del fornitore terzo di dati che ha determinato un rating non conforme,

e potremmo prenderle in considerazione per gli investimenti. Le eccezioni basate su questo criterio possono rappresentare fino al 20% del portafoglio. Per ulteriori dettagli, si rimanda all'informativa completa sul sito Web.

Fonti e trattamento dei dati

L'attribuzione dei ricavi ai temi Citi GTP viene valutata utilizzando informative dirette sulle società per azioni. Questi dati sono ricavati direttamente dalle società o tramite Bloomberg e/o FactSet. Poiché queste informazioni si baseranno su dati aziendali divulgati pubblicamente, non prevediamo che siano stimate. Le esclusioni sono applicate utilizzando i dati forniti da Sustainalytics. I dati rilevanti sono accessibili tramite la piattaforma del fornitore o un feed di dati che riceviamo dal fornitore con frequenza mensile e utilizzati nelle fasi iniziali del processo d'investimento, laddove l'universo d'investimento sia definito e per il monitoraggio periodico (vedasi sopra). Siamo a conoscenza che Sustainalytics stima alcuni dei dati ESG che riceviamo a causa della mancanza di dati disponibili.

Limitazioni delle metodologie e dei dati

Esistono delle sfide generali associate ai dati ESG, che prevediamo si applichino anche ai dati che utilizziamo provenienti dai nostri fornitori di dati e dal mercato, tra cui (tra l'altro) lacune nei dati, ritardi dei dati in termini di tempistiche di rendicontazione, metodologie divergenti tra i fornitori di dati e le fonti di dati per il calcolo o la stima dei dati e delle discrepanze tra i dati stimati e quelli riportati. Poiché si tratta di limitazioni generali del mercato che non sono specifiche dei prodotti finanziari o dei nostri fornitori di dati selezionati, riteniamo di essere ancora in grado di soddisfare adeguatamente le caratteristiche promosse dai prodotti finanziari. Inoltre, manteniamo un processo interno di revisione e approvazione del fornitore che prevede l'esame dell'approccio del fornitore di dati alla gestione dei dati, alla copertura dei dati e alle metodologie.

Dovuta diligenza

I potenziali investimenti saranno inclusi nei prodotti finanziari solamente se conformi agli elementi ESG vincolanti riassunti in precedenza, che vengono attuati nel processo d'investimento come filtri vincolanti. Inoltre, il nostro team d'investimento dedicato ai criteri ESG si occupa di perduranti discussioni interne relative agli investimenti nei prodotti finanziari.

Politiche di impegno

L'impegno non fa direttamente parte della strategia d'investimento ambientale o sociale promossa dai prodotti finanziari. Non disponiamo di procedure applicabili a controversie sulla sostenibilità nelle imprese beneficiarie degli investimenti. Tuttavia, ci impegniamo con le imprese beneficiarie degli investimenti attraverso le nostre preferenze espresse tramite voto per delega, che possono indirizzare i voti verso questioni in linea con alcune tematiche relative alla sostenibilità.

Indice di riferimento designato

I prodotti finanziari non hanno designato un indice di riferimento al fine di realizzare le proprie caratteristiche ambientali o sociali.

Informazioni importanti

Citi Private Bank si impegna a tutelare seriamente la privacy dei vostri dati. Per ulteriori informazioni, si prega di consultare il nostro sito Web:

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

Citibank Europe plc, filiale di Lussemburgo, iscritta al Registro del commercio e delle imprese del Lussemburgo con il numero B 200204, è una filiale di Citibank Europe plc. È soggetta alla supervisione congiunta della Banca Centrale europea e della Banca Centrale d'Irlanda. È inoltre soggetta alla regolamentazione limitata della Commission de Surveillance du Secteur Financier (la CSSF) nel suo ruolo di autorità di Stato membro ospite e iscritta presso la CSSF con il numero B00000395. La sua sede aziendale è al 31, Z.A. Bourmacht, 8070 Bertrange, Granducato di Lussemburgo.

Citibank Europe plc è regolamentata dalla Banca Centrale d'Irlanda. È riportata nel registro della Banca Centrale con il numero di riferimento C26553 e sottoposta a vigilanza dalla Banca Centrale europea. La sua sede legale è al 1 North Wall Quay, Dublino 1, Irlanda. Citibank Europe plc è registrata in Irlanda con il numero di registrazione della società 132781. È regolamentata dalla Banca Centrale d'Irlanda con il numero di riferimento C26553.

© 2023 Citigroup Inc. Tutti i diritti riservati. Citi e Citi with Arc Design sono marchi di servizio registrati di Citigroup o delle sue affiliate.