

# Citi Global Transformation Portfolio

## Resumo da divulgação no sítio Web

O Regulamento de Divulgação de Finanças Sustentáveis exige que façamos um resumo das informações fornecidas na nossa divulgação pré-contratual relativamente a um produto financeiro que promova características ambientais e/ou sociais e determinadas outras informações publicadas num sítio Web. A presente divulgação é realizada para estes fins pelo Citibank Europe plc, em relação a clientes da respetiva sucursal luxemburguesa em relação à Citi Global Transformation Portfolio

### Produto sem objetivo de investimento sustentável

Estes produtos financeiros promovem características ambientais ou sociais, mas não têm como objetivo o investimento sustentável.

### Características ambientais ou sociais do produto financeiro

Os produtos financeiros promovem uma contribuição positiva para o avanço dos Objetivos de Desenvolvimento Sustentável das Nações Unidas (ODS da ONU) através do investimento em empresas que têm exposição significativa a um ou mais temas de sustentabilidade selecionados por nós (Temas da Citi GTP) alinhados com um ou mais ODS da ONU. Os produtos financeiros também procuram apoiar os Princípios do Pacto Global da ONU (UNGC) e evitar investimentos em determinadas atividades com potencial para prejudicar a saúde humana e o bem-estar, aplicando exclusões obrigatórias.

### Estratégia de Investimento

Os seguintes elementos ESG obrigatórios são aplicados no processo de seleção de investimentos:

- (i) Utilizamos uma avaliação positiva para investir apenas em empresas globais cotadas em bolsa com um mínimo de 30% de receitas no respetivo último ano fiscal atribuído a um ou mais dos temas da Citi GTP. Quaisquer empresas que não cumpram este limiar, mas sobre as quais tivermos convicção suficiente de que poderão cumprir o limiar no prazo de três anos, podem ser consideradas para inclusão. As empresas incluídas com base neste critério podem incluir até 20% do valor dos produtos financeiros; e
- (ii) Utilizamos uma avaliação negativa com base em dados de terceiros para excluir: (a) as empresas que obtêm receitas da produção, venda e/ou transferência de minas terrestres antipessoais ou de bombas de fragmentação ou da produção e/ou fabrico de tabaco, (b) as empresas consideradas como estando em violação do UNGC.

As práticas de boa governação das empresas beneficiárias do investimento também são consideradas no processo de diligência devida de investimento com base numa classificação de dados ESG de terceiros. Para obter mais detalhes, consulte a divulgação completa no sítio Web.

### Proporção dos investimentos

Os produtos financeiros comprometem-se com uma proporção mínima de 80% dos investimentos para alcançar as características promovidas pelos produtos financeiros. A parte restante do investimento dos produtos financeiros poderá incluir numerário e respetivos equivalentes, incluindo títulos emitidos por fundos mútuos do mercado monetário, detidos para efeitos de uma gestão eficiente da carteira. Os produtos financeiros não pretendem fazer investimentos sustentáveis e não têm em conta a taxonomia da UE e, como tal, 0% dos produtos financeiros estão alinhados com a taxonomia. Prevê-se que toda a exposição a empresas beneficiárias do investimento seja direta.

### Monitorização das características ambientais ou sociais

Os potenciais investimentos apenas serão incluídos nos produtos financeiros se estiverem em conformidade com os elementos ESG obrigatórios resumidos acima. Os dados utilizados para efeitos de medição das exposições a receitas são atualizados anualmente. Os dados utilizados para as exclusões são atualizados trimestralmente.

### Metodologias relativas às características ambientais ou sociais

O universo de investimento dos produtos financeiros é inicialmente restringido através de avaliações positivas, para incluir empresas globais cotadas em bolsa com um mínimo de 30% de receitas do respetivo último ano fiscal atribuído a um ou mais temas da Citi GTP. Quaisquer empresas que não cumpram este limiar, mas sobre as quais tivermos convicção suficiente de que poderão cumprir o limiar no prazo de três anos, podem ser consideradas para inclusão; as empresas incluídas com base neste critério podem incluir até 20% do valor dos produtos financeiros.

Os dados de terceiros são utilizados para aplicar uma avaliação negativa para definir ainda mais o universo de investimento. Aplicamos uma exclusão baseada em receitas, em conformidade com o UNGC, para excluir empresas que obtêm qualquer receita da produção, venda e/ou transferência de minas terrestres antipessoais ou bombas de fragmentação ou da produção e/ou fabrico de tabaco.

Também aplicamos avaliações negativas para excluir empresas que são consideradas como estando em violação do UNGC. A metodologia do fornecedor de dados de terceiros é subjetiva e podemos considerá-la como incompleta. Iremos também falar de e rever empresas específicas que sinalizamos como estando em conformidade com o Pacto Global das Nações Unidas, apesar da opinião subjetiva do fornecedor de dados de terceiros, que resulta numa

classificação não conforme, e que podem ser consideradas para investimentos. As exceções baseadas neste critério podem incluir até 20% da carteira. Para obter mais detalhes, consulte a divulgação completa no sítio Web.

#### Fontes e tratamento dos dados

A atribuição de receitas aos temas do Citi GTP é avaliada através de divulgações diretas de empresas públicas. Estes dados são obtidos diretamente das empresas ou através da Bloomberg e/ou da Factset. Uma vez que estas informações se basearão em dados divulgados publicamente pela empresa, não esperamos que sejam estimativas. As exclusões são aplicadas através dos dados fornecidos pela Sustainalytics. Os dados relevantes são acedidos através da plataforma do fornecedor ou de um feed de dados que recebemos mensalmente do fornecedor e utilizados nos passos iniciais do processo de investimento, onde o universo de investimento é definido, e para monitorização periódica (consultar acima). Compreendemos que a Sustainalytics estima alguns dos dados ESG que recebemos devido à falta de dados disponíveis.

#### Limitações da metodologia e dos dados

Existem desafios gerais associados aos dados ESG, que esperamos também aplicar aos dados que utilizamos dos nossos fornecedores de dados e do mercado, que incluem (entre outros) lacunas de dados, atrasos de dados em termos de prazos de comunicação, metodologias divergentes entre fornecedores de dados e fontes de dados para o cálculo ou estimativa dos dados, e discrepâncias entre dados estimados e comunicados. Uma vez que se trata de limitações gerais no mercado que não são específicas dos produtos financeiros ou dos nossos fornecedores de dados selecionados, consideramos que ainda somos capazes de atender adequadamente às características promovidas pelos produtos financeiros. Também mantemos um processo interno de revisão e aprovação de fornecedores que envolve a revisão da abordagem do fornecedor de dados relativamente à gestão de dados, cobertura de dados e metodologias.

#### Diligência devida

Os potenciais investimentos apenas serão incluídos nos produtos financeiros se estiverem em conformidade com os elementos ESG obrigatórios resumidos acima, implementados no processo de investimento como avaliações vinculativas. Além disso, a nossa equipa de investimento dedicada a ESG está envolvida em conversas internas contínuas relacionadas com os investimentos nos produtos financeiros.

#### Políticas de envolvimento

O envolvimento não faz diretamente parte da estratégia de investimento em matéria ambiental ou social promovida pelos produtos financeiros. Não temos quaisquer procedimentos aplicáveis a controvérsias relacionadas com sustentabilidade no âmbito das empresas beneficiárias do investimento. No entanto, envolvemos empresas beneficiárias do investimento através das nossas preferências de votação por procuração, que podem direcionar os votos para questões alinhadas com algumas questões de sustentabilidade.

#### Índice de referência designado

Os produtos financeiros não designaram um índice de referência para alcançar as respetivas características ambientais ou sociais.

## Informações importantes

No Citi Private Bank, temos em consideração a privacidade dos seus dados. Para saber mais, visite o nosso sítio Web:

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

**Citibank Europe plc, Sucursal do Luxemburgo**, registada no Registo de Comércio e das Sociedades do Luxemburgo com o número B 200204, é uma sucursal do Citibank Europe plc. Está sujeita à supervisão conjunta do Banco Central Europeu e do Banco Central da Irlanda. Além disso, está sujeita ao regulamento limitado da Commission de Surveillance du Secteur Financier (a CSSF) na sua função de autoridade do Estado-Membro de acolhimento e está registada na CSSF com o número B00000395. O seu escritório encontra-se em 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Grão-Ducado do Luxemburgo.

O **Citibank Europe plc** é regulado pelo Banco Central da Irlanda. Consta do registo do Banco Central com o número de referência C26553 e é supervisionada pelo Banco Central Europeu. A sua sede social situa-se em 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irlanda. O Citibank Europe plc está registado na Irlanda com o número de registo da empresa 132781. É regulado pelo Banco Central da Irlanda com o número de referência C26553.

© 2023 Citigroup Inc. Todos os direitos reservados. Citi e Citi com o design de arco são marcas de serviço registadas do Citigroup ou das respetivas afiliadas.