

Citi Global Transformation Portfolio

Resumen de la divulgación de información del sitio web

El Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros exige que se resuma la información facilitada en nuestra divulgación de información precontractual con respecto a un producto financiero que promueva características medioambientales o sociales, así como determinada información publicada en un sitio web. Citibank Europe plc realiza la presente divulgación a estos efectos, ante los clientes de su sucursal de Luxemburgo y con respecto a la cartera Citi Global Transformation Portfolio.

Sin objetivo de inversión sostenible

Estos productos financieros promueven características medioambientales o sociales, pero no tienen como objetivo de inversión la inversión sostenible.

Características medioambientales o sociales del producto financiero

Los productos financieros promueven una contribución positiva a la consecución de los Objetivos de Desarrollo Sostenible de las Naciones Unidas (ODS de la ONU) invirtiendo en empresas que tengan una exposición significativa a una o varias temáticas de sostenibilidad seleccionadas por nosotros (temáticas de Citi GTP) que se ajusten a uno o varios ODS de la ONU. Mediante la aplicación de exclusiones vinculantes, los productos financieros también tratan de respaldar los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU) y evitar las inversiones en determinadas actividades que puedan perjudicar a la salud y al bienestar de las personas.

Estrategia de inversión

En el proceso de selección de inversiones se aplican los siguientes factores ESG vinculantes:

(i) Utilizamos filtros positivos para invertir únicamente en empresas cotizadas de todo el mundo que puedan demostrar que al menos un 30 % de todos los ingresos correspondientes a su último ejercicio fiscal concluido se ha generado a través de actividades acordes a una o varias de las temáticas de Citi GTP. Las empresas que no alcancen este umbral, pero que nos den visos razonables de poder alcanzarlo en un plazo de tres años, podrán considerarse para su inclusión; las empresas incluidas según este criterio pueden constituir hasta el 20 % del valor de los productos financieros.

(ii) Utilizamos filtros negativos basados en datos de terceros para excluir: (a) a aquellas empresas que obtienen ingresos de la producción, la venta o el traslado de minas terrestres antipersona o bombas de racimo, o de la producción o la fabricación de tabaco, y (b) a aquellas empresas que se considera que infringen el PMNU.

Las prácticas de buena gobernanza de las empresas en las que se invierte también se tienen en cuenta en el proceso de diligencia debida de las inversiones sobre la base de una calificación de datos ESG de terceros. Consulte la divulgación de información completa del sitio web para obtener más detalles.

Proporción de inversiones

Los productos financieros destinan una proporción mínima del 80 % de las inversiones a alcanzar las características que promueven. La parte restante de la inversión de los productos financieros puede comprender efectivo y equivalentes de efectivo, incluidos los valores emitidos por fondos de inversión del mercado monetario, mantenidos con fines de gestión eficiente de la cartera. Los productos financieros no tienen como objetivo realizar inversiones sostenibles ni tienen en cuenta la taxonomía de la UE, por lo que el 0 % de los productos financieros se ajustan a la taxonomía. Se espera que toda la exposición a las empresas en las que se invierte sea directa.

Seguimiento de las características medioambientales o sociales

Las inversiones potenciales solo se incluirán en los productos financieros si cumplen los factores ESG vinculantes resumidos anteriormente. Los datos utilizados para calcular la exposición de los ingresos se actualizan anualmente, y los relativos a las exclusiones, de forma trimestral.

Metodologías para las características medioambientales o sociales

El universo de inversión de los productos financieros se reduce inicialmente utilizando filtros positivos, con el fin de incluir empresas cotizadas de todo el mundo cuyos ingresos correspondientes a su último ejercicio fiscal concluido se atribuyan, como mínimo en un 30 %, a una o varias de las temáticas de Citi GTP. Las empresas que no alcancen este umbral, pero que nos den visos razonables de poder alcanzarlo en un plazo de tres años, podrán considerarse para su inclusión; las empresas incluidas según este criterio pueden constituir hasta el 20 % de los productos financieros.

Se utilizan datos de terceros para aplicar filtros negativos que permitan definir de forma más precisa el universo de inversión. Aplicamos una exclusión basada en los ingresos, acorde con el PMNU, para excluir a aquellas empresas que obtienen ingresos de la producción, la venta o el traslado de minas terrestres antipersona o bombas de racimo, o de la producción o la fabricación de tabaco.

También aplicamos filtros negativos para excluir a aquellas empresas que se considera que infringen el PMNU. La metodología del proveedor de datos externo es subjetiva y podemos considerarla incompleta. Asimismo, analizaremos y revisaremos empresas concretas que consideramos que cumplen el Pacto Mundial de las Naciones Unidas, a pesar de que se hayan calificado como infractoras según la opinión subjetiva del proveedor de datos externo, y

quedará a nuestra discreción invertir en ellas. Las excepciones basadas en este criterio pueden constituir hasta el 20 % de la cartera. Consulte la divulgación de información completa del sitio web para obtener más detalles.

Fuentes de datos y procesamiento

La atribución de ingresos a las temáticas de Citi GTP se evalúa a partir de la información divulgada directamente por las empresas cotizadas. Estos datos se obtienen de forma directa de las empresas o a través de Bloomberg o Factset. Dado que esta información se basará en datos divulgados públicamente por las empresas, no prevemos que se trate de una estimación. Las exclusiones se aplican utilizando los datos proporcionados por Sustainalytics. Se accede a los datos pertinentes a través de la plataforma del proveedor o de una fuente de datos que recibimos del proveedor mensualmente, y se utilizan en las etapas iniciales del proceso de inversión, en las que se define el universo de inversión, y para realizar un seguimiento periódico (véase lo descrito anteriormente). No obstante, entendemos que Sustainalytics estima algunos de los datos ESG que recibimos debido a la falta de datos disponibles.

Limitaciones de las metodologías y los datos

Existen ciertas dificultades generales asociadas a los datos ESG, que suponemos que también se aplican a los datos que obtenemos de nuestros proveedores de datos y del mercado. Entre otras dificultades, se incluyen las lagunas en los datos, los desfases en los plazos de publicación, las divergencias en las metodologías entre los proveedores de datos y las fuentes de datos para el cálculo o la estimación de los datos y las discrepancias entre los datos estimados y los publicados. Dado que se trata de limitaciones generales del mercado que no son específicas de los productos financieros ni de nuestros proveedores de datos seleccionados, consideramos que podemos seguir cumpliendo debidamente las características promovidas por los productos financieros. También contamos con un proceso interno de revisión y aprobación de proveedores que consiste en revisar el enfoque del proveedor de datos con respecto a la gestión de datos, la cobertura de datos y las metodologías.

Diligencia debida

Las inversiones potenciales solo se incluirán en los productos financieros si cumplen con los factores ESG vinculantes resumidos anteriormente, que se implementan en el proceso de inversión como filtros vinculantes. Además, nuestro equipo de inversión especializado en materia ESG participa periódicamente en debates internos relacionados con las inversiones en los productos financieros.

Políticas de implicación

La implicación no forma parte de la estrategia de inversión medioambiental o social promovida por los productos financieros. No disponemos de procedimientos aplicables a las controversias en materia de sostenibilidad relacionadas con las empresas en las que invertimos. Sin embargo, mantenemos un diálogo activo con las empresas en las que invertimos a través de nuestras preferencias de voto por delegación, que pueden orientar los votos hacia cuestiones que se corresponden con algunos aspectos relativos a la sostenibilidad.

Índice de referencia designado

Los productos financieros no han designado ningún índice de referencia con el fin de lograr sus características medioambientales o sociales.

Información importante

En Citi Private Bank tratamos la privacidad de sus datos con la mayor seriedad. Para obtener más información, visite nuestro sitio web:

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

Citibank Europe plc, Luxembourg Branch, inscrita en el Registro Mercantil de Luxemburgo con el número B 200204, es una sucursal de Citibank Europe plc. Está sujeta a la supervisión conjunta del Banco Central Europeo y del Banco Central de Irlanda. Asimismo, está sujeta a una regulación limitada por parte de la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF), en su calidad de autoridad del Estado miembro anfitrión, y está registrada en la CSSF con el número B00000395. Su domicilio social se encuentra en 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Gran Ducado de Luxemburgo.

Citibank Europe plc está regulada por el Banco Central de Irlanda. Figura en el registro del Banco Central de Irlanda con el número de referencia C26553 y está supervisada por el Banco Central Europeo. Su domicilio social se encuentra en 1 North Wall Quay, Dublín 1, Irlanda. Citibank Europe plc está registrada en Irlanda con el número 132781. Está regulada por el Banco Central de Irlanda con el número de referencia C26553.

© 2023 Citigroup Inc. Todos los derechos reservados. Citi y Citi with Arc Design son marcas de servicios registradas de Citigroup o sus empresas subsidiarias.