

Citi Equity (US and Global) ESG Focus Portfolios

Resumen de información del sitio web

El Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) establece que debemos resumir la información que figura en el documento precontractual de los productos financieros que promueven características ambientales o sociales, además de cierta información que se publique en un sitio web. Citibank Europe plc, en relación con los clientes de su sucursal en Luxemburgo y a propósito de Citi US Equity ESG Focus Portfolio y Citi Global Equity ESG Focus Portfolio, ofrece la siguiente información a estos efectos.

Ausencia de objetivo de inversión sostenible

Estos productos financieros promueven características ambientales o sociales, pero no tienen como objetivo una inversión sostenible.

Características ambientales o sociales del producto financiero

Estos productos financieros promueven el apoyo a los Principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU) y tratan de evitar inversiones en determinadas actividades que puedan causar daños al bienestar y la salud humana mediante la aplicación de exclusiones vinculantes.

Estrategia de inversión

En el proceso de selección de inversiones se aplican los siguientes elementos vinculantes en materia medioambiental, social y de gobierno corporativo (ESG) mediante el uso de datos de proveedores de datos ESG externos:

- (i) se aplica un cribado positivo en materia de ESG al universo de inversión para garantizar que las inversiones presenten calificaciones ESG favorables (según la definición de nuestros proveedores de datos ESG externos); y
- (ii) se aplican las siguientes exclusiones: (a) empresas que no cumplan los Principios del PMNU o que nuestros proveedores de datos ESG externos consideren que infringen el PMNU; (b) empresas con ingresos superiores al 10 % (en su ejercicio fiscal anterior) en determinadas actividades, y (c) empresas con una vinculación directa o indirecta a la fabricación o distribución de armas controvertidas y armas civiles.

Las buenas prácticas de gobernanza de las empresas en las que se invierte también se tienen en cuenta en el proceso de diligencia debida de inversión a partir de una calificación de los datos ESG de terceros. Consulte la información completa del sitio web para conocer todos los detalles.

Proporción de inversiones

Los productos financieros se comprometen a mantener una proporción mínima del 80 % de inversiones para alcanzar las características que promueven. El resto de inversiones de los productos financieros está formado por efectivo y equivalentes de efectivo, incluidos valores emitidos por fondos de inversión colectiva del mercado monetario, que se mantienen con fines de gestión eficiente de la cartera. Los productos financieros no pretenden realizar inversiones sostenibles y no tienen en cuenta la taxonomía de la UE y, así, un 0 % de los productos financieros se ajustan a ella. Se espera que toda la exposición a las empresas en las que se invierte sea directa.

Seguimiento de las características ambientales o sociales

Las estrategias de inversión de los productos financieros se implementan a través de un proceso de inversión que actualiza las puntuaciones ESG de los productos financieros anualmente y, mensualmente, actualiza los datos de exclusión sobre los que tomamos nuestras decisiones de inversión. Esto garantiza que las inversiones utilizadas en los productos financieros se ajusten a los elementos vinculantes usados por este producto para promover características ambientales o sociales.

Metodologías de las características ambientales o sociales

Se utilizan el MSCI US Index (Citi US Equity ESG Focus Portfolio) y el MSCI World Index (Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) para establecer el universo base de los productos financieros pertinentes, al que se aplica un cribado positivo en materia de ESG y filtros ESG de exclusión basados en datos y calificaciones ESG de terceros. El proveedor de datos determina las calificaciones ESG teniendo en cuenta en qué medida está una empresa expuesta a riesgos ESG importantes y cómo gestiona su exposición al riesgo. Los puntos de datos de los filtros de exclusión los determina el proveedor de datos externo teniendo en cuenta las actividades de esa empresa. Consulte la información completa del sitio web para conocer todos los detalles.

Fuentes y tratamiento de datos

El cribado positivo en materia de ESG y los filtros de exclusión se aplican utilizando las calificaciones ESG y los datos que proporciona Sustainalytics. A los datos pertinentes se accede a través del sitio web del proveedor o mediante una fuente de datos que recibimos mensualmente de este, y se utilizan en el proceso de inversión, donde se define el universo de inversión, y para su supervisión periódica (véase lo anterior). Puesto que recurrimos a datos de terceros para cumplir con las características ambientales o sociales de los productos financieros, no realizamos estimaciones propias de ningún dato. Entendemos que Sustainalytics obtiene una pequeña cantidad de los datos ESG que recibimos mediante estimación debido a la falta de datos disponibles.

Limitaciones de las metodologías y los datos

Existen una serie de problemas generales asociados a los datos ESG que creemos que también se aplican a los datos que empleamos de nuestro proveedor de datos, entre los que se incluyen: lagunas de información, retrasos en los datos por los plazos de presentación de informes, métodos divergentes entre los proveedores de datos y las fuentes de datos para el cálculo o estimación de los datos, y discrepancias entre los datos estimados y los notificados. Dado que se trata de limitaciones generales del mercado que no son específicas de los productos financieros o del proveedor de datos seleccionado, consideramos que no afectan a nuestra capacidad para cumplir adecuadamente con las características que promueven los productos financieros. También mantenemos un proceso interno de revisión y aprobación de proveedores que implica la revisión del enfoque de dicho proveedor sobre la gestión de datos, cobertura de datos y metodologías.

Diligencia debida

Las inversiones potenciales solo se incluirán en los productos financieros si cumplen con los elementos vinculantes en materia medioambiental, social y de gobierno corporativo (ESG) resumidos anteriormente, que se implementan en el proceso de inversión como filtros vinculantes. Además, nuestro equipo de inversión dedicado a los criterios ESG mantiene debates internos continuos relacionados con las inversiones en los productos financieros.

Políticas de implicación

La implicación no forma parte directa de la estrategia de inversión ambiental o social que promueven los productos financieros. No disponemos de ningún procedimiento aplicable a los litigios relacionados con la sostenibilidad en las empresas en las que se invierte. Sin embargo, nos implicamos con las empresas en las que se invierte a través de nuestras preferencias de voto por delegación, que pueden dirigir los votos a cuestiones alineadas con algunos asuntos relacionados con la sostenibilidad.

Índice de referencia designado

Los productos financieros no han designado un índice de referencia para cumplir con las características ambientales o sociales que promueven.

Información importante

En Citi Private Bank nos tomamos en serio la privacidad de sus datos. 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 el Banco Central de Irlanda. Además, está sometida a una regulación limitada de la *Commission de Surveillance du Secteur Financier* (CSSF), en su calidad de autoridad del Estado miembro de acogida, y registrada en la CSSF con el número B00000395. Su oficina administrativa 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 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 número de registro de la sociedad 132781. Está regulada por el Banco Central de Irlanda con el número de referencia C26553.

© 2022 Citigroup Inc. Todos los derechos reservados. «Citi» y «Citi» con el diseño del arco son marcas de servicio registradas de Citigroup o sus empresas asociadas.