

30 юни 2026 г.

Citi Global Equity ESG Focus Portfolio (закрит на 13.11.2025 г.)

Обобщение на информацията, публикувана на уебсайта

Регламентът относно оповестяването на информация във връзка с устойчивото финансиране (SFDR) изисква да бъде предоставено обобщение на информацията, съдържаща се в преддоговорното оповестяване относно финансов продукт, който насърчава екологични и/или социални характеристики, както и на определена друга информация, публикувана на уебсайт. Настоящото оповестяване се извършва от Citibank Europe plc за целите на този регламент по отношение на клиентите на нейния клон в Люксембург във връзка със Citi Global Equity ESG Focus Portfolio.

Липса на цел за устойчиво инвестиране

Настоящият финансов продукт насърчава екологични или социални характеристики, но няма за инвестиционна цел устойчиво инвестиране.

Екологични или социални характеристики на финансовия продукт

Финансовият продукт насърчава спазването на принципите на Глобалния договор на ООН (UN Global Compact – UNGC) и се стреми да избягва инвестиции в определени дейности, които могат да окажат неблагоприятно въздействие върху човешкото здраве и благосъстояние, чрез прилагането на задължителни критерии за изключване.

Инвестиционна стратегия

При процеса на подбор на инвестиции се прилагат следните задължителни критерии, свързани с екологичните, социалните и управленските фактори (ESG), като се използват данни от външни доставчици на ESG данни и/или оценка от CIM:

- (i) Прилага се положителен ESG филтър върху инвестиционната вселена, за да се гарантира, че инвестициите имат благоприятни ESG оценки (според външните доставчици на ESG данни); и
- (ii) Прилагат се следните изключения: а) дружества, които не спазват принципите на UNGC или са определени като нарушители на UNGC от външните доставчици на ESG данни и/или оценката на CIM; б) дружества, които реализират повече от 10% от приходите си (през предходната финансова година) от определени дейности; и в) дружества, които имат пряка или непряка връзка с производството или разпространението на противоречиви оръжия.

При необходимост CIM може да допълни оценката на външния доставчик на ESG данни със собствена оценка. Въз основа на вътрешния При необходимост CIM може да допълни оценката на външния доставчик на ESG данни със собствена оценка. Въз основа на вътрешния фундаментален анализ можем да включим позиции във финансовия продукт, които според външните данни не отговарят на някой от горепосочените задължителни критерии, когато считаме, че данните на външния доставчик са недостатъчни, непълни или неточни, и когато според нашия собствен анализ дружеството всъщност отговаря на тези критерии. Подобен подход се прилага и за критерии, които не са обхванати от външния доставчик на данни. По аналогичен начин можем да изключим позиции, които според външните данни изглеждат изпълняват един или повече от критериите, но за които не сме съгласни с оценката на външния доставчик на ESG данни, въз основа на собствения ни фундаментален анализ или на други източници на данни.

Добрите практики за корпоративно управление на дружествата, в които се инвестира, също се оценяват в рамките на процеса по инвестиционна проверка въз основа на ESG оценка от външен доставчик на ESG данни. За повече подробности вижте пълното оповестяване на уебсайта.

Дял на инвестициите

Финансовият продукт се ангажира минимум 80% от инвестициите да бъдат насочени към постигане на характеристиките, които продуктът насърчава. Останалата част от инвестициите се състои от парични средства и парични еквиваленти, включително ценни книжа, емитирани от фондове на паричния пазар, държани с цел ефективно управление на портфейла. Финансовият продукт не възнамерява да извършва устойчиви инвестиции и не взема предвид Таксономията на ЕС, поради което 0% от инвестициите са съобразени с нея. Очаква се цялата експозиция към дружествата, в които се инвестира, да бъде пряка.

Мониторинг на екологичните или социалните характеристики

Инвестиционната стратегия на финансовия продукт се прилага чрез инвестиционен процес, при който ESG оценките на финансовия продукт се актуализират ежегодно, а данните за критериите за изключване, въз основа на които се вземат инвестиционните решения, се актуализират ежемесечно. Този процес се допълва от собствената оценка на CIM. По този начин се гарантира, че инвестициите, включени във финансовия продукт, съответстват на задължителните критерии, които продуктът използва за насърчаване на екологични или социални характеристики.

Методологии

Индексът MSCI World Index (за Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) се използва за определяне на базовата инвестиционна вселена на финансовия продукт, върху която се прилагат положителен ESG филтър, основан на ESG рейтингите, както и ESG филтри за изключване, базирани на ESG рейтинги и данни, предоставени от независим доставчик. ESG рейтингите се определят от доставчика на данни въз основа на степента, в която дадено дружество е изложено на съществени ESG рискове, както и на това доколко ефективно управлява тази експозиция към риск. Данните, използвани при прилагането на филтрите за изключване, се определят от независимия доставчик на ESG данни въз основа на дейностите на съответното дружество. При необходимост CIM може да допълни ESG оценката на независимия доставчик със собствена оценка. За повече информация, моля, вижте пълното оповестяване на уебсайта.

Източници и обработка на данните

Положителният ESG филтър и ESG изключенията се прилагат чрез ESG оценки и данни, предоставяни от Sustainalytics. Данните се получават чрез уебсайта на доставчика или чрез канал за подаване на данни, който получаваме от доставчика ежесечно, и се използват в инвестиционния процес при определяне на инвестиционната вселена и при периодичен мониторинг (виж по-горе). Тъй като използваме данни от външни доставчици, за да изпълним екологичните и социалните характеристики на финансовия продукт, не извършваме собствени оценки или изчисления на данните. Разбираме, че Sustainalytics изчислява приблизително малка част от ESG данните, които получаваме, поради липсата на налична информация.

CIM може също така да използва други публично достъпни източници, както и анализи и проучвания от външни брокери и информация, събрана по време на срещи с ръководството на дружествата.

Ограничения на методологиите и данните

Съществуват общи предизвикателства, свързани с ESG данните, които очакваме да се отнасят и за данните, използвани от нашия доставчик на данни. Те включват, наред с други: липса на данни за определени показатели; закъснения в предоставянето на данни поради сроковете за отчитане; различия в методологиите между отделните доставчици на данни и източниците на информация при изчисляването или оценяването на данните; несъответствия между оценени (изчислени) и реално отчетени данни. Тъй като това са общи ограничения на пазара, които не са специфични за финансовите продукти или за изборите от нас доставчик на данни, считаме, че все пак можем адекватно да изпълним характеристиките, които финансовите продукти насърчават. Поддържаме също така вътрешен процес за преглед и одобрение на доставчици, който включва оценка на подхода на доставчика на данни по отношение на: управлението на данните; обхвата на покритие на данните; използваните методологии.

CIM може да допълни ESG оценката на външния доставчик на данни със собствена оценка с цел намаляване на пропуските в наличните данни.

Проверка

Потенциалните инвестиции ще бъдат включени във финансовия продукт само ако отговарят на обобщените по-горе задължителни ESG критерии, които са въведени в инвестиционния процес като задължителни критерии за подбор (скрининг). Освен това, нашият инвестиционен екип, специализиран в ESG, участва в текущи вътрешни обсъждания, свързани с инвестициите във финансовия продукт.

Политики за ангажираност

Ангажираността с дружествата, в които се инвестира, не е пряка част от екологичната или социалната инвестиционна стратегия, насърчавана от финансовия продукт. Ние не разполагаме с процедури, приложими към противоречия, свързани с устойчивостта, в дружествата, в които инвестираме. Въпреки това, ние осъществяваме взаимодействие с дружествата, в които инвестираме, чрез нашите предпочитания при гласуване чрез пълномощник, които могат да насочват гласовете към въпроси, свързани с определени аспекти на устойчивостта.

Определен референтен бенчмарк

Финансовият продукт не е определил референтен показател (бенчмарк) с цел постигане на своите екологични или социални характеристики.

Важна информация

В Citi Private Bank приемаме сериозно защитата на Вашите лични данни. За да научите повече, моля, посетете нашия уебсайт:

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

Citibank Europe plc, клон Люксембург, регистриран в Люксембургския търговски и фирмен регистър под номер В 200204, е клон на Citibank Europe plc. Той е обект на съвместен надзор от Европейската централна банка и Централната банка на Ирландия. Освен това подлежи на ограничен надзор от страна на Комисията за надзор на финансовия сектор на Люксембург (Commission de Surveillance du Secteur Financier – CSSF) в качеството ѝ на орган на приемащата държава членка и е регистриран в CSSF под номер B00000395. Седалището на дейността му се намира на адрес: 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Велико херцогство Люксембург.

Citibank Europe plc се регулира от Централната банка на Ирландия. Тя е вписана в регистъра на Централната банка с референтен номер C26553 и е под надзора на Европейската централна банка. Регистрираният ѝ офис се намира на адрес: 1 North Wall Quay, Dublin 1, Ирландия. Citibank Europe plc е регистрирана в Ирландия с регистрационен номер на дружеството 132781. Тя се регулира от Централната банка на Ирландия под референтен номер C26553.

© 2026 Citigroup Inc. Всички права запазени. Citi и Citi с дизайна Arc са регистрирани търговски марки за услуги на Citigroup или нейните свързани дружества.