

30 czerwca 2026 r.

Citi Global Equity ESG Focus Portfolio (zamknięty 13.11.2025 r.)

Podsumowanie informacji ujawnianych na stronie internetowej

Rozporządzenie w sprawie ujawniania informacji związanych ze zrównoważonym rozwojem w sektorze usług finansowych („SFDR”) wymaga od nas podsumowania informacji zawartych w dokumentacji przedumownej dotyczącej produktu finansowego promującego aspekty środowiskowe lub społeczne, a także niektórych innych informacji publikowanych na stronie internetowej. Niniejsze informacje są ujawniane w tym celu przez Citibank Europe plc w odniesieniu do portfela Citi Global Equity ESG Focus Portfolio oferowanego klientom jego oddziału w Luksemburgu.

Brak celu dotyczącego zrównoważonych inwestycji

Ten produkt finansowy promuje aspekty środowiskowe lub społeczne, lecz jego celem inwestycyjnym nie jest dokonywanie zrównoważonych inwestycji.

Aspekty środowiskowe lub społeczne produktu finansowego

Produkt finansowy promuje poszanowanie zasad inicjatywy ONZ Global Compact (UNGC) oraz dąży do unikania inwestycji w określone rodzaje działalności, które mogą szkodzić zdrowiu i dobrostanowi ludzi, poprzez stosowanie wiążących wyłączeń.

Strategia inwestycyjna

W procesie wyboru inwestycji stosuje się następujące wiążące elementy środowiskowe, społeczne i związane z ładem korporacyjnym („ESG”), wykorzystując dane zewnętrznych dostawców danych ESG i/lub ocenę CIM:

- (i) wobec uniwersum inwestycyjnego stosuje się pozytywną selekcję ESG, aby zapewnić, że inwestycje charakteryzują się korzystnymi ocenami ESG (zgodnie z ocenami naszych zewnętrznych dostawców danych ESG); oraz
- (ii) stosuje się następujące wyłączenia: (a) spółki, które na podstawie ocen naszych zewnętrznych dostawców danych ESG i/lub oceny CIM są uznawane za nieprzestrzegające zasad UNGC lub za podmioty naruszające te zasady; (b) spółki, w przypadku których ponad 10% przychodów w poprzednim roku obrotowym pochodziło z określonych rodzajów działalności; oraz (c) spółki bezpośrednio lub pośrednio powiązane z produkcją lub dystrybucją broni kontrowersyjnej.

W indywidualnych przypadkach CIM może uzupełnić ocenę ESG sporządzoną przez zewnętrznego dostawcę danych własną oceną. Na podstawie naszego wewnętrznego przeglądu fundamentalnego możemy uwzględnić w produkcie finansowym pozycje, które według danych zewnętrznego dostawcy wydają się niezgodne z co najmniej jednym z powyższych wiążących elementów, jeżeli uznamy, że dane te są niewystarczające, niekompletne lub niedokładne, a nasza własna analiza fundamentalna wykaże, że dana spółka jest zgodna ze wszystkimi wskazanymi powyżej wiążącymi elementami. Podobną procedurę stosujemy wobec emitentów, którzy nie są objęci zakresem danych zewnętrznego dostawcy. Analogicznie możemy wykluczyć pozycje, które według danych zewnętrznego dostawcy wydają się spełniać co najmniej jedno z powyższych kryteriów, jeżeli na podstawie własnej analizy fundamentalnej lub innych źródeł danych nie zgadzamy się z tą oceną.

W ramach analizy inwestycyjnej prowadzonej z zachowaniem należytej staranności uwzględnia się również dobre praktyki w zakresie zarządzania stosowane przez spółki, w które dokonano inwestycji, na podstawie ocen ESG nadanych przez zewnętrznego dostawcę danych. Szczegółowe informacje są dostępne w pełnej wersji ujawnienia na stronie internetowej.

Udział inwestycji

Produkt finansowy zobowiązuje się, że co najmniej 80% jego inwestycji będzie służyć osiągnięciu promowanych przez niego aspektów środowiskowych lub społecznych. Pozostałą część inwestycji w ramach produktu finansowego stanowią środki pieniężne i ich ekwiwalenty, w tym papiery wartościowe emitowane przez fundusze inwestycyjne rynku pieniężnego, utrzymywane w celu efektywnego zarządzania portfelem. Produkt finansowy nie zamierza dokonywać żadnych zrównoważonych inwestycji i nie uwzględni taksonomii UE, dlatego udział jego inwestycji zgodnych z taksonomią UE wynosi 0%. Oczekuje się, że cała ekspozycja na spółki, w które dokonano inwestycji, będzie miała charakter bezpośredni.

Monitorowanie aspektów środowiskowych lub społecznych

Strategia inwestycyjna produktu finansowego jest realizowana w ramach procesu inwestycyjnego, w którym oceny ESG produktu są aktualizowane raz w roku, natomiast dane dotyczące wyłączeń, na których opierają się nasze decyzje inwestycyjne, są aktualizowane co miesiąc. Uzupełnieniem tego procesu jest własna ocena CIM. Zapewnia to zgodność inwestycji w ramach produktu finansowego z wiążącymi elementami stosowanymi przez ten produkt w celu promowania aspektów środowiskowych lub społecznych.

Metody

MSCI World Index (Citi Global Equity ESG Focus Portfolio) służy do określenia bazowego uniwersum inwestycyjnego produktu finansowego, wobec którego stosuje się pozytywną selekcję według ocen ESG oraz filtry wykluczające oparte na ocenach i danych ESG pochodzących od zewnętrznych dostawców. Ocenę ESG są ustalane przez dostawcę danych z uwzględnieniem stopnia narażenia spółki na istotne ryzyka ESG oraz skuteczności zarządzania przez nią tym narażeniem. Dane wykorzystywane w filtrach wykluczających są określane przez zewnętrznego dostawcę danych z uwzględnieniem działalności prowadzonej przez spółkę. W indywidualnych przypadkach CIM może uzupełnić ocenę ESG sporządzoną przez zewnętrznego dostawcę danych własną oceną. Szczegółowe informacje są dostępne w pełnej wersji ujawnienia na stronie internetowej.

Źródła i przetwarzanie danych

Pozytywna selekcja ESG oraz wyłączenia ESG są stosowane z wykorzystaniem ocen i danych ESG dostarczanych przez Sustainalytics. Odpowiednie dane są pozyskiwane za pośrednictwem strony internetowej dostawcy lub comiesięcznego strumienia danych otrzymywanego od dostawcy i wykorzystywane w procesie inwestycyjnym do określania uniwersum inwestycyjnego oraz prowadzenia okresowego monitorowania (zob. powyżej). Ponieważ w celu realizacji aspektów środowiskowych i społecznych promowanych przez produkt finansowy korzystamy z danych zewnętrznych, nie dokonujemy własnych oszacowań danych. Z naszych informacji wynika, że Sustainalytics szacuje niewielką część otrzymywanych przez nas danych ESG ze względu na brak dostępnych danych.

CIM może również korzystać z innych publicznie dostępnych źródeł, analiz zewnętrznych firm maklerskich oraz informacji uzyskanych podczas spotkań z kierownictwem spółek.

Ograniczenia dotyczące metod i danych

Z danymi ESG wiążą się ogólne wyzwania, które, jak zakładamy, dotyczą również danych pozyskiwanych od naszego dostawcy – obejmują one między innymi luki w danych, opóźnienia wynikające z harmonogramów sprawozdawczych, rozbieżności w metodykach stosowanych przez dostawców danych i w źródłach danych wykorzystywanych do ich obliczania lub szacowania, a także różnice między danymi szacowanymi a raportowanymi. Ponieważ są to ogólne ograniczenia rynkowe, które nie dotyczą konkretnie ani produktów finansowych, ani wybranego przez nas dostawcy danych, uważamy, że nadal jesteśmy w stanie należycie realizować aspekty promowane przez produkty finansowe. Stosujemy również wewnętrzny proces przeglądu i zatwierdzania dostawców, obejmujący ocenę podejścia dostawcy danych do zarządzania danymi, zakresu danych oraz stosowanych metodyk.

W celu ograniczenia skutków ewentualnych luk w danych CIM może uzupełnić ocenę ESG sporządzoną przez zewnętrznego dostawcę danych własną oceną.

Należyta staranność

Potencjalne inwestycje zostaną uwzględnione w produkcie finansowym wyłącznie wówczas, gdy będą zgodne z podsumowanymi powyżej wiążącymi elementami ESG, które są stosowane w procesie inwestycyjnym jako wiążące kryteria selekcji. Ponadto nasz zespół inwestycyjny specjalizujący się w obszarze ESG regularnie prowadzi wewnętrzne dyskusje dotyczące inwestycji wchodzących w skład produktu finansowego.

Polityka dotycząca zaangażowania

Zaangażowanie nie stanowi bezpośredniego elementu strategii inwestycyjnej produktu finansowego w zakresie promowania aspektów środowiskowych lub społecznych. Nie stosujemy żadnych procedur dotyczących kontrowersji związanych ze zrównoważonym rozwojem w spółkach, w które dokonano inwestycji. Angażujemy się jednak w relacje ze spółkami, w które dokonano inwestycji, poprzez stosowane przez nas preferencje dotyczące wykonywania prawa głosu z akcji, które mogą ukierunkowywać sposób głosowania w sprawach związanych z niektórymi zagadnieniami zrównoważonego rozwoju.

Wyznaczony wskaźnik referencyjny

Dla produktu finansowego nie wyznaczono wskaźnika referencyjnego na potrzeby osiągnięcia promowanych przez niego aspektów środowiskowych lub społecznych.

Ważne informacje

W Citi Private Bank poważnie traktujemy ochronę Państwa danych. Więcej informacji można znaleźć na naszej stronie internetowej:

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

Citibank Europe plc, oddział w Luksemburgu, wpisany do Rejestru Handlowego i Spółek w Luksemburgu pod numerem B 200204, jest oddziałem Citibank Europe plc. Podlega wspólnemu nadzorowi Europejskiego Banku Centralnego oraz Banku Centralnego Irlandii. Ponadto w ograniczonym zakresie podlega nadzorowi Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF), która pełni funkcję organu właściwego dla przyjmującego państwa członkowskiego, i jest wpisany do rejestru CSSF pod numerem B00000395. Biuro oddziału mieści się pod adresem 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Wielkie Księstwo Luksemburga.

Citibank Europe plc odlega nadzorowi Banku Centralnego Irlandii. Figuruje w rejestrze Banku Centralnego Irlandii pod numerem referencyjnym C26553 i podlega nadzorowi Europejskiego Banku Centralnego. Jej siedziba rejestrowa mieści się pod adresem 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irlandia. Citibank Europe plc jest zarejestrowana w Irlandii pod numerem rejestracyjnym spółki 132781. Podlega nadzorowi Banku Centralnego Irlandii pod numerem referencyjnym C26553.

© 2026 Citigroup Inc. Wszelkie prawa zastrzeżone. Citi oraz Citi with Arc Design są zarejestrowanymi znakami usługowymi Citigroup lub jej podmiotów powiązanych.