

Su tvarumu susijusios finansinės informacijos atskleidimo reglamentas (SFDR)

Pagrindinio neigiamo poveikio tvarumui (PASI) ataskaitos santrauka

Finansinės rinkos dalyvis

„Citibank Europe plc“ (Liuksemburgo filialas), LEI: N1FBEDJ5J41VKZLO2475

Santrauka

„Citibank Europe plc“ (Liuksemburgo filialas) (LEI: N1FBEDJ5J41VKZLO2475) atsižvelgia į savo investicinių sprendimų pagrindinį neigiamą poveikį (PAI) tvarumo veiksniams, susijusiems su tam tikrais portfeliais, kaip nurodyta toliau. Ši ataskaita yra konsoliduota „Citi Investment Management“ (toliau – CIM), teikiančios portfelio valdymo paslaugas, ataskaita apie PAI tvarumo veiksniams. Jei jis šias paslaugas teikia per „Citibank Europe plc“ (Liuksemburgo filialas), šis subjektas bus finansų rinkos dalyvis pagal su tvarumu susijusios finansinės informacijos atskleidimo reglamentą. Ši ataskaita apima ataskaitinį laikotarpį nuo 2023 m. sausio 1 d. iki 2023 m. gruodžio 31 d. ir pateikiama lyginant su ankstesniu ataskaitiniu laikotarpiu.

Į CIM procesus nebuvo ir nėra įtrauktas visų PAI nagrinėjimas investavimo procese, neplanuojami jokie veiksmai ir nenumatomi jokie tikslai. Tačiau, kaip aprašyta toliau, tam tikrų konkrečių portfelių („ESG Focus Portfolios“, „Global Transformation Portfolio“ (GTP) ir „MACS ESG Portfolios“) atžvilgiu, į tam tikrus PAI investavimo procese buvo atsižvelgta ribotai, taikant atmetimo kriterijus, kurie visiškai arba iš dalies atitinka atitinkamus PAI, arba taikant atrankos procesus, apimančius investicijas, kurios, kaip nustatyta, pasižymi palankiais ASV reitingais, kuriems gali turėti įtakos tam tikri PAI arba kurie gali būti susiję su tam tikrais PAI, arba investuojant į 8 straipsnyje nurodytus fondus, investuojančius į tvarias investicijas (toliau tekste – 8 straipsnio+ fondai), arba 9 straipsnyje nurodytus fondus, kurie, priimdami investicinius sprendimus dėl tvarių investicijų, privalo atsižvelgti į PAI rodiklius.

Konkretus PAI, į kurį atsižvelgta taikant pirmiau aprašytus atmetimo kriterijus (išsamiau aprašytas toliau šioje ataskaitoje), buvo toks: i) 4 PAI: iškastinio kuro sektoriuje veikiančių bendrovių rizika, ii) 10 PAI: JT Pasaulinio susitarimo principų ir Ekonominio bendradarbiavimo ir plėtros organizacijos (EBPO) gairių tarptautinėms įmonėms pažeidimai; iii) 14 PAI: prieštarai vertinamų ginklų (priešpėstinių minų, kasetinių šaudmenų, cheminių ir biologinių ginklų) poveikis. Tačiau galimas jų poveikio mažinimas apsiriboja tik tais portfeliais, kurie į juos atsižvelgia kaip į investavimo proceso dalį, todėl jų poveikis visam CIM turimam turtui yra ribotas. CIM neplanuoja jokių su PAI susijusių veiksnių ar nenustatė su PAI susijusių tikslų ir, apskritai, atsižvelgiant į ribotas CIM galimybes įsitraukti į įmones, į kurias investuojama (t. y. atsižvelgiant į palyginti nedidelius turimus įmonių, į kurias investuojama, akcijų paketus), CIM negali numatyti, ar kitais ataskaitiniais metais PAI padidės ar sumažės.

Kaip minėta pirmiau, šiuo metu CIM į PAI tvarumo veiksniams investavimo procesuose atsižvelgia tik tam tikruose portfeluose, o būdama pasaulinė investicijų valdymo organizacija ir atsižvelgdama į Privačiojo banko veiklos pobūdį, CIM siekia teikti investicinius sprendimus, skirtus klientų tikslams įgyvendinti, laikydamasi savo veiklos reguliavimo sistemos. Šiuo metu CIM šiame pranešime pateiktus PAI duomenis naudoja tik reguliavimo tikslais.

Galimybė gauti išsamius ir patikimus ASV duomenis apie įmones, į kurias investuojama, tebėra nuolatinis rinkos iššūkis. CIM metodika, skirta PAI nustatyti, pagrįsta informacija, gaunama iš trečiųjų šalių duomenų teikėjų, kurie yra pripažinti įsitvirtinę tokių duomenų rinkimo specialistai ir kurie gali rinkti tokius duomenis veiksmingiau ir detaliau nei CIM šiuo metu. Šiuo metu CIM nepapildo trečiųjų šalių duomenų nuosava analize, todėl remiasi šių duomenų teikėjų naudojamomis duomenų rinkimo, vertinimo ir skaičiavimo metodikomis.

Kai nėra galimybės gauti išsamių ir patikimų ASV duomenų apie įmones, į kurias investuojama, CIM supranta, kad MSCI (duomenų teikėjas, kurio paslaugomis naudojasi rengdama PAI duomenis šiai ataskaitai) taiko perskaičiavimo metodą, t. y. užuot dariusi prielaidą, kad neigiamas poveikis yra lygus nuliui, arba neįtraukusi atitinkamos investicijos į toliau atskleistus PAI duomenis, kiekybiniais duomenimis pagrįstų PAI rodiklių atveju MSCI sieks užpildyti tokias duomenų spragas, priskirdama investicijoms, apie kurias trūksta duomenų, vertes pagal PAI duomenų apie investicijas, apie kurias tam tikrų rodiklių duomenys yra prieinami, vidurkį. Ši vertinimo metodika gali būti netiksli, nereprezentatyvi ar kitaip neatspindėti faktinių investicijų, kurių duomenys buvo apskaičiuoti, PAI verčių ir gali netiesiogiai reikšti prielaidą, kad vertybinių popierių emitentų, kurie pateikia duomenis, vidutinė rodiklio vertė yra reprezentatyvi portfelio investicijoms, apie kurias nėra informacijos. Kokybiniais duomenimis pagrįstų PAI rodiklių atveju MSCI neigiamą poveikį nustato remdamasi įmonės, į kurią investuojama, pateiktais duomenimis arba duomenimis apie ją. Tačiau tais atvejais, kai tokių duomenų nėra, pagal MSCI metodiką jie bus interpretuojami kaip orientaciniai (t. y. ne galutiniai ir nebūtinai tikslūs), kad neigiamo poveikio nėra. Duomenys apie visus PAI buvo prieinami apie 76 proc. vertinamo portfelio, o apie likusius 24 proc. duomenų nebuvo. MSCI iš naujo įvertino pozicijas pagal turimus duomenis tik toliau nurodytų PAI atžvilgiu, kad įvertintų pozicijas, kurių duomenų nepavyko gauti.

Rodikliai, taikomi investicijoms į įmones, į kurias investuojama: 1. Taršos ŠESD, 2. Išmetamo anglies dvideginio išlakos, 3. Įmonių, į kurias investuojama, ŠESD išmetimo intensyvumas, 5. Neatsinaujinančios energijos suvartojimo ir gamybos dalis, 6. Energijos suvartojimo intensyvumas pagal didelį poveikį klimatui darantį sektorių, 8. Į vandenį išmetami teršalai, 9. Pavojingų ir radioaktyviųjų atliekų santykis, 12. Neišlygintas darbo užmokesčio pagal lytį skirtingumas, 13. Lyčių atstovavimas valdybose

Rodikliai, taikomi investicijoms į valstybes ir daugiavaldžias įmones: 15. ŠESD išmetimo intensyvumas

Papildomi rodikliai, susiję su socialiniais ir darbuotojų, pagarbos žmogaus teisėms, kovos su korupcija ir kyšininkavimu klausimais: 23. Vidutinis politinio stabilumo balas

MSCI į „dabartinę visų investicijų vertę“ (tai yra vardiklio skaičius, naudojamas apskaičiuojant tam tikrus PAI rodiklius (pvz., ŠESD išmetimo intensyvumo rodiklius)) neįtraukia grynųjų pinigų, pinigų ekvivalentų ir bet kokių kitų turto rūšių ir (arba) sandorių, pavyzdžiui, išvestinių finansinių priemonių (toliau – gryniesiems pinigais). CIM mano, kad jos portfeliuose laikomi gryniesiems pinigais naudojami ne tiesiogiai ar netiesiogiai „investicijoms“ į įmones, į kurias investuojama, ir (arba) valstybes finansuoti, o neinvesticiniams tikslams ir veiksmingam portfelio valdymui, todėl neturėtų būti laikomi „visomis investicijomis“. CIM taip pat mano, kad grynųjų pinigų neįtraukimas yra konservatyvesnis metodas, nes dėl to vardiklio skaičius tampa mažesnis, o bendras PAI rodiklis – didesnis. CIM nuolat peržiūri procesus ir valdymo sistemas, kad įsitikintų, jog jie yra pagrįsti dabartine geriausia praktika, ir dėl šio požiūrio CIM gali vėliau persvarstyti PAI ataskaitoje pateiktą požiūrį (dėl vieno ar kelių punktų).

Svarbi informacija

„Citi Private Bank“ rimtai žiūri į jūsų duomenų privatumą. Jei reikia daugiau informacijos, apsilankykite mūsų svetainėje:

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

„Citibank Europe plc“, Liuksemburgo filialas, įregistruotas Liuksemburgo prekybos ir įmonių registre numeriu B 200204, yra „Citibank Europe plc“ filialas. Jį bendrai prižiūri Europos Centrinis Bankas ir Airijos centrinis bankas. Be to, jį ribotai reguliuoja „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) kaip pagrindinės valstybės narės institucija ir jis yra registruotas CSSF numeriu B00000395. Jo būstinės adresas yra 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Liuksemburgo Didžioji Hercogystė.

„Citibank Europe plc“ veikia reguliuojama Airijos centrinio banko. Jis įregistruotas Centrinio banko registre registracijos numeriu C26553, o jo veiklą prižiūri Europos Centrinis Bankas. Jo registracijos adresas yra 1 North Wall Quay, Dublin 1, Airija. „Citibank Europe plc“ yra registruotas Airijos įmonių registre numeriu 132781. Jo veiklą reguliuoja Airijos centrinis bankas, registracijos numeris C26553.

© 2024 „Citigroup Inc.“ Visos teisės saugomos. „Citi“ ir „Citi“ su „Arc Design“ yra „Citigroup“ ar susijusių įmonių registruotieji paslaugų ženklai.