

Regulamentul privind informațiile privind durabilitatea în sectorul serviciilor financiare (SFDR)

Sumarul raportului referitor la declarația privind principalele efecte negative asupra factorilor de durabilitate (PASI)

Participant la piața financiară

Citibank Europe plc (Luxembourg Branch), LEI: N1FBEDJ5J41VKZLO2475

Sumar

Citibank Europe plc (Luxembourg Branch) (LEI: N1FBEDJ5J41VKZLO2475) ia în considerare principalele efecte negative („PAI”) ale deciziilor sale de investiții asupra factorilor de durabilitate în legătură cu anumite portofolii, astfel cum sunt prevăzute mai jos. Prezenta declarație reprezintă declarația consolidată a principalelor efecte negative asupra factorilor de durabilitate ale Citi Investment Management (CIM) care oferă servicii de gestionare a portofoliilor. În cazul în care oferă aceste servicii prin intermediul Citibank Europe plc (Luxembourg Branch), entitatea respectivă va fi un participant la piața financiară conform SFDR. Prezenta declarație acoperă perioada de referință cuprinsă între 1 ianuarie 2023 și 31 decembrie 2023 și include o comparație cu perioada de referință anterioară.

Procesele CIM nu au luat și nu iau în considerare toate PAI în procesul său investițional, nu sunt planificate acțiuni sau nu sunt stabilite obiective. Dar, în raport cu anumite portofolii specifice (ESG Focus Portfolios, Global Transformation Portfolio (GTP) și MACS ESG Portfolios), astfel cum sunt descrise mai jos, anumite PAI au fost luate în considerare în procesul de investiții în mod limitat, prin aplicarea unor criterii de excludere care se raportează la PAI relevante (integral sau parțial), sau prin aplicarea unor procese de selecție capturând investițiile identificate ca prezentând ratinguri ESG favorabile, care pot fi influențate de sau asociate cu anumite PAI, sau prin investițiile în fondurile prevăzute în articolul 8 cu investiții durabile („Fondurile prevăzute în articolul 8”) sau fondurile prevăzute în articolul 9, care sunt obligate să ia în considerare indicatorii PAI în cadrul procesului lor investițional pentru investiții durabile.

Principalele efecte negative specifice avute în vedere în baza criteriilor de excludere descrise mai sus (detalii oferite în continuare în prezenta declarație) au fost: i) PAI 4: Expunerea la întreprinderile care își desfășoară activitatea în sectorul combustibililor fosili, ii) PAI 10: Încălcări ale principiilor Pactului mondial al ONU și ale Orientărilor pentru întreprinderile multinaționale, elaborate de Organizația pentru Cooperare și Dezvoltare Economică (OCDE) și iii) PAI 14: Expunerea la arme controversate (mine antipersonal, muniții cu dispersie, arme chimice și biologice). Totuși, potențiala atenuare a efectelor lor negative este limitată la portofoliile care le iau în considerare ca parte din procesul lor investițional și, astfel, au un impact limitat în totalitatea participațiilor CIM. CIM nu a planificat acțiuni referitoare la PAI și nu a stabilit obiective legate de PAI, și recunoscând în mod mai general capacitățile limitate ale CIM de implicare în societățile în care s-a investit (și anume având în vedere numărul relativ scăzut de acțiuni deținute în societățile în care s-a investit), CIM nu se află în poziția de a estima creșterea sau scăderea PAI în următorul an de raportare.

După cum s-a menționat mai sus, luarea în considerare de către CIM a principalelor efecte negative asupra factorilor de durabilitate, în procesul de investiții, este momentan limitată doar la anumite portofolii, și, fiind o organizație globală de administrare a investițiilor, și ca urmare a naturii activității de Bancă Privată, CIM dorește să livreze soluții de investiții create pentru a îndeplini obiectivele clienților, în limitele cadrului de reglementare în care aceasta își desfășoară activitatea. CIM folosește în prezent datele despre PAI incluse în prezenta declarație numai în scopul furnizării informațiilor impuse de regulamente.

Capacitatea de a obține date ESG detaliate și fiabile cu privire la societățile în care s-a investit rămâne o provocare permanentă pe piață. Metodologia CIM de identificare a PAI se bazează pe furnizori de date terți, care sunt specialiști recunoscuți pentru obținerea acestor date și care pot obține aceste date într-un mod mai eficient și la un nivel mai detaliat decât ar putea CIM în acest moment. În prezent, CIM nu completează datele furnizate de terți cu o analiză proprie, bazându-se astfel pe metodologiile pentru colectarea, estimarea și calculul datelor utilizate de acești furnizori de date.

Când pentru o investiție nu există date disponibile despre PAI, CIM înțelege că MSCI (furnizorul de date pe care îl utilizează pentru strângerea datelor PAI pentru acest raport) utilizează o abordare de reponderare, și anume în loc să presupună că efectul negativ este egal cu zero sau să excludă investiția respectivă din cifrele PAI prezentate mai jos, pentru indicatorii PAI bazați pe date cantitative, MSCI va urmări să completeze aceste goluri de date alocând valori investițiilor cu date lipsă pe baza mediei datelor PAI pentru investițiile pentru care datele sunt disponibile în anumiți indicatori. Această

metodologie de estimare poate să nu fie exactă, reprezentativă sau să nu reflecte valorile PAI reale ale investițiilor pentru care datele au fost estimate, și poate presupune în mod implicit că valoarea medie a indicatorului pentru emitenții titlurilor de valoare care nu raportează date reprezintă investițiile din portofoliu pentru care nu există informații. Pentru indicatorii PAI bazați pe date calitative, efectele negative sunt identificate de MSCI prin utilizarea datelor raportate de sau despre compania în care s-a investit. Totuși, când aceste date nu sunt disponibile, acestea vor fi interpretate de metodologia MSCI ca indicând (și anume nu în mod concret sau nu neapărat corect) lipsa unui efect negativ. Au fost disponibile date pentru aproximativ 76 % din portofoliu vizat la nivelul tuturor PAI, iar pentru restul de 24 % nu au existat date disponibile. MSCI a reponderat expunerile din datele disponibile, numai în legătură cu PAI de mai jos, pentru a estima expunerile unde nu erau disponibile date.

Indicatori aplicabili investițiilor în societățile în care s-a investit: 1. Emisii de gaze cu efect de seră (GES), 2. Amprenta de carbon, 3. Intensitatea GES a societăților în care s-a investit, 5. Ponderea consumului și a producției de energie din surse neregenerabile, 6. Intensitatea consumului de energie per sector climatic cu impact ridicat, 8. Emisii în apă, 9. Ponderea deșeurilor periculoase și a deșeurilor radioactive, 12. Disparitatea salarială de gen în formă neajustată, 13. Diversitatea de gen în cadrul consiliului

Indicatori aplicabili investițiilor în entități suverane și supranaționale: 15. Intensitatea GES

Indicatori suplimentari pentru aspectele sociale și cele legate de personal, respectarea drepturilor omului, chestiunile legate de combaterea corupției și a dării și luării de mită: 23. Scorul mediu în materie de stabilitate politică

În sensul prezentei declarații, numerarul, echivalentele de numerar și orice alte tipuri de active/tranzacții, cum ar fi instrumentele derivate, („Numerar”) sunt excluse de MSCI din „valoarea curentă a tuturor investițiilor” (aceasta fiind numitorul utilizat pentru a calcula anumiți indicatori de evaluare PAI (de ex., cifrele privind intensitatea GES)). CIM consideră că Numerarul deținut în portofoliile sale nu este utilizat pentru a finanța în mod direct sau indirect „investiții” în societăți în care s-a investit/ entități suverane, ci mai degrabă în scopuri neinvestiționale, și pentru gestionarea eficientă a portofoliilor, și astfel nu ar trebui să constituie „toate investițiile”. CIM consideră, de asemenea, că excluderea Numerarului este o abordare conservatoare, având în vedere că aceasta face numitorul mai mic și, ca urmare, punctajele PAI generale mai mari. CIM revizuieste în mod continuu procesele și cadrele noastre de guvernare pentru a se asigura că se bazează pe bunele practici actuale și, în ceea ce privește această abordare, CIM poate revizui în timpul util abordarea adoptată în declarația PAI (la unul sau mai multe puncte).

Informații importante

La Citi Private Bank, luăm în serios confidențialitatea datelor dumneavoastră. Pentru a afla mai multe, vizitați site-ul nostru web:

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

Citibank Europe plc, Luxembourg Branch, înregistrată în Registrul Comerțului și al Societăților din Luxemburg sub numărul B 200204, este o sucursală a Citibank Europe plc. Se supune supervizării comune a Băncii Centrale Europene și a Băncii Centrale a Irlandei. Face și obiectul reglementării limitate a Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF), în rolul său ca autoritate gazdă dintr-un Stat membru, și este înregistrată la CSSF sub numărul B00000395. Sediul său social se află în 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Marele Ducat al Luxemburgului.

Citibank Europe plc este reglementată de Banca Centrală a Irlandei. Aceasta apare în registrul Băncii Centrale cu numărul de referință C26553 și este supravegheată de Banca Centrală Europeană. Sediul său social se află în 1 North Wall Quay, Dublin 1, Irlanda. Citibank Europe plc este înregistrată în Irlanda cu numărul de înregistrare 132781. Aceasta este reglementată de Banca Centrală a Irlandei sub numărul de referință C26553.

© 2024 Citigroup Inc. Toate drepturile rezervate. Citi și Citi with Arc Design sunt mărci înregistrate de servicii ale Citigroup sau ale afiliaților săi.