

Su tvarumu susijusios finansinės informacijos atskleidimo reglamentas (SFDR)

Pagrindinio neigiamo poveikio tvarumui (PNPT) ataskaitos santrauka

Santrauka

„Citibank Europe plc“ (Liuksemburgo filialas) (LEI: N1FBEDJ5J41VKZLO2475) atsižvelgia į savo investicinių sprendimų pagrindinį neigiamą poveikį (PNP) 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 PNP tvarumo veiksnius. 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 dėl pagrindinio neigiamo poveikio tvarumui apima ataskaitinį laikotarpį nuo 2024 m. sausio 1 d. iki 2024 m. gruodžio 31 d. ir pateikiama lyginant su ankstesniais ataskaitiniais laikotarpiais.

CIM neįtraukė PNP nagrinėjimo bendrai subjekto lygiu į jo investavimo procesus, taip pat CIM nesuplanavo jokių veiksmų, siekdamas sumažinti PNP ar su PBP susijusių tikslų, pateiktų šioje ataskaitoje. Tačiau, kaip aprašyta toliau, tam tikrų konkrečių portfelių („ESG Focus Portfolios“ ir „MACS ESG Portfolios“) atžvilgiu į tam tikrus PNP investavimo procese buvo atsižvelgta ribotai, taikant atmetimo kriterijus, kurie visiškai arba iš dalies atitinka atitinkamus PNP, arba taikant atrankos procesus, apimančius investicijas, kurios, kaip nustatyta, pasižymi palankiais aplinkos, socialiniais ir bendrovių valdymo (ASV) reitingais, kuriems gali turėti įtakos tam tikri PNP arba kurie gali būti susiję su tam tikrais PNP, 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 PNP rodiklius.

Konkretus PNP, į kurį atsižvelgta taikant pirmiau aprašytus atmetimo kriterijus (išsamiau aprašytas toliau šioje ataskaitoje), buvo toks: i) 4 PNP: Iškastinio kuro sektoriuje veikiančių bendrovių rizika, ii) 10 PNP: JT Pasaulinio susitarimo principų ir Ekonominio bendradarbiavimo ir plėtros organizacijos (EBPO) gairių tarptautinėms įmonėms pažeidimai; iii) 14 PNP: prieštaringai 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 PNP susijusių veiksmų ar nenustatė su PNP 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 PNP padidės ar sumažės.

Kaip minėta pirmiau, šiuo metu CIM į PNP tvarumo veiksnius 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, laikydamosi savo veiklos reguliavimo sistemos. Šiuo metu CIM šiame pranešime pateiktus PNP duomenis naudoja tik reguliavimo tikslais.

Galimybė gauti išsamius ir patikimus ASV duomenis apie įmones, į kurias investuojama, tebėra nuolatinis rinkos iššūkis. CIM metodika, skirta PNP nustatyti, pagrįsta informacija, gaunama iš trečiųjų šalių duomenų teikėjo (MSCI), kuris yra pripažintas įsitvirtinęs tokių duomenų rinkimo specialistas ir kuris gali rinkti tokius duomenis veiksmingiau ir tiksliau nei CIM šiuo metu. Šiuo metu CIM nepapildo trečiųjų šalių duomenų nuosava analize, todėl šioje ataskaitoje remiasi šio duomenų teikėjo 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 taiko perskaiciavimo metodą, t. y. užuot dariusi prielaidą, kad neigiamas poveikis yra

lygus nuliui, arba neįtraukusi atitinkamos investicijos į toliau atskleistus PNP duomenis, kiekybiniais duomenimis pagrįstų PNP rodiklių atveju MSCI sieks užpildyti tokias duomenų spragas, priskirdama investicijoms, apie kurias trūksta duomenų, vertes pagal PNP 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, PNP verčių ir gali netiesiogiai reikšti prielaidą, kad vertybinių popierių emitentų, kurie pateikia duomenis, vidutinė rodiklio vertė yra reprezentatyvi portfelio investicijoms, apie kurias nėra informacijos. Kiekybiniais duomenimis pagrįstų PNP 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 PNP 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 PNP 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

Šioje ataskaitoje visi vertybiniai popieriai, kuriuos valdo CIM, jos nuožiūra įtraukti į „dabartinę visų investicijų vertę“ (t. y. vardiklio skaičius, naudojamas apskaičiuojant tam tikrus PNP rodiklius (pvz., ŠESD išmetimo intensyvumo rodiklius), išskyrus: grynuosius pinigus; grynujų pinigų ekvivalento turtą; išvestines finansines priemones ir kitą turtą, laikomą portfeluose, kurie nenaudojami ne tiesiogiai ar netiesiogiai investicijoms į įmones, į kurias investuojama, ir (arba) valstybes finansuoti, o neinvesticiniams tikslams, pvz., portfelio valdymui. CIM taip pat mano, kad grynujų pinigų neįtraukimas yra konservatyvesnis metodas, nes dėl to vardiklio skaičius tampa mažesnis, o bendras PNP rodiklis – didesnis. CIM prižiūri procesus ir valdymo sistemas pagal dabartinių geriausių praktikų, reguliavimo institucijų reikalavimus ir (arba) pagal kliento lūkesčius, siekiant užtikrinti jų atitiktį dabartiniams įstatymams ir reglamentams. 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.

© 2025 „Citigroup Inc.“ Visos teisės saugomos. „Citi“ ir „Citi“ su „Arc Design“ yra „Citigroup“ ar susijusių įmonių registruotieji paslaugų ženklai.