

Finantsteenuste kestlikkusega seotud teabe avalikustamise määrus (SFDR)

Aruande „Peamiste jätkusuutlikkusele avaldatavate negatiivsete mõjude (PASI) ülevaade” kokkuvõte

Kokkuvõte

Citibank Europe plc (Luksemburgi filiaal) (LEI: N1FBDJ5J41VKZLO2475) võtab arvesse oma investeerimisotsuste peamisi negatiivseid mõjusid (edaspidi: PAId) jätkusuutlikkuse teguritele seoses teatavate portfelliidega, täpsemalt MACS ESG Core mudelportfelliidega, mis jäid aruandeperioodi jooksul avatuks, samuti Citi Global Equity ESG Focus portfelliga, ja Citi Global Fixed Income ESG Focus Portfolio (edaspidi: ESG Focus Portfolid), mis suleti aruandeperioodi jooksul 2025. aasta neljandas kvartalis – need on käesolevasse aruandesse kaasatud, kuna need kuulusid vaatlusperioodi enamiku ajaks aruande ulatusse (edaspidi: portfelliid). Käesolev aruanne on portfelliidusteenuseid osutava Citi Investment Managementi (CIM) jätkusuutlikkuse tegureid käsitlev konsolideeritud aruanne. Kui see osutab neid teenuseid Citibank Europe plc (Luksemburgi filiaal) kaudu, on see üksus finantsteenuste kestlikkusega seotud teabe avalikustamise määruse (SFDR) kohaselt finantsturu osaline. Käesolev aruanne jätkusuutlikkuse teguritele avaldatava peamise negatiivse mõju kohta hõlmab vaatlusperioodi 1. jaanuarist 2025 kuni 31. detsembrini 2025 ning sisaldab võrdlust eelmiste vaatlusperioodidega.

CIM ei ole oma investeerimisprotsessis varem ega ka praegu laiemalt arvestanud PAIdega ettevõtte tasandil, samuti ei ole CIM kavandanud mingeid meetmeid PAIde mõju leevendamiseks ega seadnud eesmärgi seoses avalduses esitatud PAIdega. Siiski võeti allpool kirjeldatud portfelliide puhul investeerimisprotsessis teatavaid PAIsid arvesse piiratud ulatuses, kohaldades välistamiskriteeriume, mis vastavad (täielikult või osaliselt) asjaomastele PAIdele, või rakendades sõelumisprotsesse, mille käigus valiti välja investeringud, millel on soodsad keskkonna-, sotsiaalsete ja juhtimistavade (ESG) reitingutega, mida võivad mõjutada või millega võivad olla seotud teatud PAId, või investeerides artikli 8 kohastes jätkusuutlikke investeringuid tegevatesse fondidesse (edaspidi: artikli 8+ fondid) või artikli 9 kohastes fondidesse, mis peavad jätkusuutlike investeringute puhul oma investeerimisotsuste tegemisel arvesse võtma PAI-näitajaid.

Enne ESG Focus Portfiliote sulgemist 2025. aasta neljandas kvartalis olid eespool kirjeldatud välistamiskriteeriumide alusel arvesse võetud konkreetsed PAId (üksikasjad on kirjeldatud käesoleva avalduse edasises osas) järgmised: i) PAI 4: Fossiilkütusetööstuses tegutsevate ettevõtete osakaal portfellis, ii) PAI 10: ÜRO globaalse kokkuleppe põhimõtete ja Majanduskoostöö ja Arengu Organisatsiooni (OECD) rahvusvaheliste ettevõtetele suunatud suuniste rikkumised ning iii) PAI 14: Kokkupuude vaidlusaluste relvadega (jalaväemiinid, kassettlähingumoon, keemiarelvad ja bioloogilised relvad). Siiski piirdus nende mõju võimalik leevendamine portfelliidega, kus neid võeti investeerimisprotsessi raames arvesse, ning seetõttu oli selle mõju CIMi kogu portfellile piiratud. CIM ei ole kavandanud ühtegi PAIga seotud meetet ega seadnud PAIga seotud eesmärgi, ning arvestades üldiselt CIMi piiratud võimalusi suhelda investeerimisobjektidega (st arvestades suhteliselt väikseid osalusi investeerimisobjektides), ei ole CIMil võimalik ennustada, kas PAId järgmisel aruandeaastal suurenevad või vähenevad.

Nagu eespool märgitud, piirdub CIMi poolt meie investeerimisprotsessides PAIde arvestamine jätkusuutlikkuse tegurite osas praegu ainult portfelliidega; olles ülemaailmne investeerimisjuhtimisorganisatsioon ning arvestades erapanga äritegevuse olemust, on CIMi eesmärk pakkuda investeerimisalahendusi, mis on kavandatud klientide eesmärkide saavutamiseks, järgides selleks reguleerivat raamistikku, milles ettevõtte tegutseb. CIM kasutab käesolevas avalduses sisalduvaid PAI-andmeid praegu üksnes regulatiivse avalikustamise eesmärgil.

BlackRocki poolt toetatav Citi Portfolio Solutions käivitati 15. detsembril 2025 pärast selle väljakuulutamist 2025. aasta septembris. Selle uuendatud tegevusmudeli raames viidi teatud varem CIMi poolt hallatud omastrateegiad üle BlackRockile, kes tegeleb nüüd nende strateegiate investeringute haldamisega. CIM vastutab endiselt klientide nõustamise ja kõnealuste portfelliide järelevalve eest, kuid välja arvatud teatud volituste puhul ei ole CIM alates 15. detsembrist 2025 vastutanud nende portfelliide omal äranägemisel toimuva investeerimisjuhtimise eest. Kõnealused varad on siiski käesolevasse aruandesse kaasatud hallatavate varade ja muude näitajate arvutamiseks, kuna üleminek toimus aruandeaasta jooksul. Kui CIM ei ole säilitanud vastutust nende portfelliide investeringute haldamise eest, ei kajastata neid varasid järgmise aasta aruandes. Lisaks on käesolevasse aastaaruandesse kaasatud ka fikseeritud tuluga väärtipaberite ja aktsiate ESG-keskseid portfelle, mis suleti 2025. aasta neljandas kvartalis, kuid edaspidi neid enam aruandesse ei kaasata.

Võimalus hankida investeerimisobjektide kohta üksikasjalikke ja usaldusväärseid ESG-andmeid on turul endiselt pidev väljakutse. CIMi meetodika PAIde kindlakstegemiseks tugineb kolmandast osapooltest andmepakkujale (MSCI), kes on selliste andmete hankimise valdkonnas tunnustatud spetsialist ning suudab neid andmeid hankida tõhusamalt ja üksikasjalikumal tasemel, kui CIM seda praegusel hetkel suudaks. CIM ei täienda käesoleva avalduse raames kolmandate osapoolte andmeid oma analüüsiga ning tugineb seetõttu andmepakkujate poolt kasutatavatele andmete kogumise, hindamise ja arvutamise meetoditele.

Kui investeringu kohta PAI-andmed puuduvad, kasutab MSCI CIMi andmetel kaalude ümberjaotamise meetodit – st selle asemel, et eeldada, et negatiivne mõju on null, või jätta asjaomane investering allpool avaldatud PAI-näitajatest välja, püüab MSCI kvantitatiivsetel andmetel põhinevate PAI-näitajate puhul selliseid andmelünki täita, omistades puuduvate andmetega investeringutele väärtused, mis põhinevad nende investeringute PAI-andmete keskmisel, mille kohta on teatud näitajate puhul andmed kättesaadavad. Kõnealune hindamismeetod ei pruugi olla täpne, representatiivne ega muul viisil kajastada nende investeringute tegelikke PAI-väärtusi, mille kohta andmed on hinnanguliselt arvutatud, ning võib kaudselt eeldada, et andmeid esitavate väärtpaberite emitentide keskmine näitaja on representatiivne ka nende portfelli investeringute suhtes, mille kohta teave puudub. Kvalitatiivsetel andmetel põhinevate PAI-näitajate puhul määrab MSCI kahjulikud mõjud kindlaks, kasutades selleks investeerimisobjekti enda esitatud või selle kohta avaldatud andmeid. Kui sellised andmed aga puuduvad, tõlgendab MSCI meetodika seda kui osundust (st mitte lõplikku ega tingimata täpset) sellele, et kahjulikku mõju ei ole.

Andmed olid kättesaadavad ligikaudu 81% ulatuses kõigi PAIde hõlmatud portfelist, ülejäänud 19% puhul andmed puudusid. MSCI on kättesaadavate andmete põhjal ümberkaalunud positsioone, kuid seda ainult allpool loetletud PAIde puhul, et hinnata positsioone, mille kohta andmed puudusid.

Investeerimisobjektidesse tehtavate investeringute suhtes kohaldatavad näitajad: 1. Kasvuhoonegaaside heitkogused, 2. Süsiniku jalajälg, 3. Investeerimisobjektide kasvuhoonegaaside intensiivsus, 5. Taastumatute energiaallikate osakaal tarbimises ja tootmises, 6. Energiatarbimise intensiivsus kliimale suure mõjuga sektorite kaupa, 8. Heitmed vette, 9. Ohtlike jäätmete ja radioaktiivsete jäätmete suhe, 12. Korrigeerimata sooline palgalõhe, 13. Juhatuse sooline mitmekesisus

Riikide ja riikideüleste organisatsioonide investeringute suhtes kohaldatavad näitajad: 15. Kasvuhoonegaaside intensiivsus

Täiendavad näitajad sotsiaal- ja tööõukusimuste, inimõiguste austamise ning korruptsiooni- ja altkäemaksuvastase võitluse valdkonnas: 23. Poliitilise stabiilsuse keskmine hinnang

Käesoleva avalduse kontekstis on kõik väärtpaberid, mida CIM haldab oma äranägemise järgi (sealhulgas 2025. aasta neljandas kvartalis suletud ESG Focuse portfellid), hõlmatud „kõigi

investeringute praegune väärtus” (see on nimetaja, mida kasutatakse teatavate PAI-näitajate (nt kasvuhoonegaaside intensiivsuse näitajate) arvutamiseks, välja arvatud järgmised: sularaha; sularahaga võrdväärseid varad; tuletisinstrumentid ja muud portfellides hoitavad varad, mida ei kasutata otseselt ega kaudselt investeringute rahastamiseks investeerimisobjektideks olevatesse äriühingutesse või riikidesse, vaid pigem muudel kui investeerimiseesmärkidel, näiteks portfelli haldamiseks. CIM peab ka rahaliste vahendite väljajätmist konservatiivsemaks lähenemisviisiks, kuna see vähendab nimetaja väärtust ja omakorda suurendab PAI-indeksi üldskoore. CIMi protsesse ja juhtimisraamistikku vaadatakse läbi vastavalt kehtivatele parimatele tavadele, reguleerivate asutuste nõuetele ja/või klientide ootustele ning selleks, et tagada kehtivate seaduste ja määruste järgimine. CIM võib õigel ajal uuesti läbi vaadata käesolevas PAIde avalduses kasutatud lähenemisviisi (ühes või mitmes punktis).

Oluline teave

Citi Private Bankis võtame teie andmete privaatsust tõsiselt. Lisateabe saamiseks külastage meie veebisaiti: <https://www.privatebank.citibank.com/privacy>

Citibank Europe plc, Luksemburgi filiaal, mis on registreeritud Luksemburgi kaubandus- ja äriregistris numbri B 200204 all, on Citibank Europe plc filiaal. Selle üle teevad ühist järelevalvet Euroopa Keskpang ja Iirimaa Keskpang. Lisaks allub ettevõtte piiratud järelevalvele, mida teeb Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) vastuvõtva liikmesriigi pädeva asutusena, ning on registreeritud CSSFis numbri B00000395 all. Ettevõtte kontor asub aadressil Z.A. 31. Bourmicht, 8070 Bertrange, Luksemburgi Suurhertsogiriik.

Citibank Europe plc tegevust reguleerib Iirimaa Keskpang. See on kantud keskpanga registrisse viitenumbri C26553 ning selle tegevuse üle teeb järelevalvet Euroopa Keskpang. Ettevõtte registrijärgne asukoht on 1 North Wall Quay, Dublin 1, Iirimaa. Citibank Europe plc on registreeritud Iirimaa äriregistri numbri 132781 all. Seda reguleerib Iirimaa Keskpang viitenumbri C26553 alusel.

© 2026 Citigroup Inc. Kõik õigused on kaitstud. Citi ja Citi koos Arc Designiga on Citigroupi või selle tütarettevõtjate registreeritud teenusemärgid.