

Jätkusuutlikkust käsitleva teabe finantsteenuste sektoris avalikustamise määrus (SFDR)

Jätkusuutlikkusteguritele avalduva põhilise negatiivse mõju (PAI) aruanne

Finantsturu osaline

Citibank Europe plc (Luxembourg Branch), LEI: N1FBEDJ5J41VKZLO2475

Kokkuvõte

Citibank Europe plc (Luxembourg Branch) (LEI: N1FBEDJ5J41VKZLO2475) kaalub oma investeerimisotsuste põhilist negatiivset mõju (PAI) jätkusuutlikkusteguritele seoses teatavate portfelliga, mis on välja toodud allpool. Käesolev aruanne on Citibank Europe plc (Luxembourg Branch) (CIM) konsolideeritud aruanne jätkusuutlikkustegurite kohta. See aruanne hõlmab vaatlusperioodi 1. jaanuarist 2022 kuni 31. detsembrini 2022.

CIMi protsessid ei ole kaasanud ega kaasa kõiki PAIsid oma investeerimisprotsessi ning enamasti ei kavandata mingeid meetmeid ega seata eesmärgi. Kuid teatavate konkreetsete portfelliga seoses (ESG Focus Portfolios, Sustainable Multi Thematic Portfolios (SMT) ja MACS ESG Portfolios), nagu allpool kirjeldatud, võeti investeerimisprotsessis teatud PAIsid piiratud määral arvesse, kohaldades selleks välistuskriteeriume, mis on (täielikult või osaliselt) asjaomaste PAIdega seotud, või kohaldades sõelumisprotsesse, mis hõlmavad soodsate ESG-reitingutega investeringuid, mida teatavad PAId võivad mõjutada või mis võivad olla nendega seotud, või investeerides artikli 8 kohastes jätkusuutlike investeringutega fondidesse (artikli 8+ fondid) või artikli 9 kohastes fondidesse, mis peavad oma jätkusuutlike investeringute kohta investeerimisotsuste tegemise protsessis PAI näitajaid arvesse võtma.

Konkreetsed PAId, mida eelpool kirjeldatud välistuskriteeriumide kaudu arvesse võeti, olid: i) PAI 4: Positsioonid ettevõtetes, mis tegutsevad fossiilkütuste sektoris, ii) 10: ÜRO ülemaailmse kokkuleppe põhimõtete ja Majanduskoostöö ja Arengu Organisatsiooni (OECD) hargmaistele ettevõtjatele kehtestatud suuniste rikkumised, iii) PAI 14: Vastuoluliste relvadega (jalaväemiinid, kassetlahingumoon, keemiarelvad ja bioloogilised relvad) seotud positsioon. Nende mõju võimalik leevendamine piirub siiski nende portfelliga, mis neid oma investeerimisprotsessi osana arvestavad, ja seega on nende mõju CIMi osalustele tervikuna piiratud. Kuna CIM ei ole enamikel juhtudel ühtegi PAIga seotud meedet kavandanud ega PAIga seotud eesmärgi seadnud, ning arvestades üldisemalt CIMi piiratud võimalusi investeerimisobjektide kaasamiseks (st arvestades suhteliselt väikesed osalusi investeerimisobjektideks olevates ettevõtetes) – CIM ei ole prognoosinud, kas PAId järgmisel aruandeaastal suurenevad või vähenevad.

Nii jätkusuutlikkustegurite kui ka PAIde arvesse võtmine CIMi investeerimisprotsessis areneb pidevalt. Nagu eespool märgitud, piirub see praegu ainult teatavate portfelliga ning kuna CIM on ülemaailmne investeringute haldusorganisatsioon ja erapanga tegevuse iseloomu tõttu püüab CIM pakkuda investeerimislahendusi, mis on loodud klientide eesmärkide täitmiseks tema asukoha regulatiivses raamistikus. CIMi eesmärk on kehtestada asjakohaste andmete kogumise protsess ja luua võrdlusalus, mille põhjal saab arendada tulevasi meetmeid.

Võime saada investeerimisobjektide kohta üksikasjalikke ja usaldusväärseid ESG andmeid on turul endiselt suur väljakutse. CIMi meetodika PAIde kindlakstegemiseks tugineb kolmandatest isikutest andmepakkujatele, kes on selliste andmete hankimise spetsialistid ning kes saavad hankida selliseid andmeid tõhusamalt ja üksikasjalikumalt kui CIM seda praegusel ajahetkel teha saaks. CIM ei täienda praegu kolmandate isikute andmeid oma analüüsiga ja tugineb seetõttu andmete kogumise, hindamise ja arutamise meetodikale, mida need andmepakkujad kasutavad.

Kui investeringu kohta ei ole PAI andmeid võimalik saada, kasutab MSCI CIMi arusaamise kohaselt osakaalu muutmist – st selle asemel, et eeldada, et kahjulik mõju on null või vastav investering allpool avaldatud PAI näitajatest välja jätta, püüab MSCI kvantitatiivsetel andmetel põhinevate PAIde osas andmetes olevad lüngad täita, määrates selleks puuduvate andmetega investeringutele väärtused, mis põhinevad nende investeringute, mille kohta andmed on olemas, PAI andmete keskmistel ja teatud näitajatel. See hindamismetoodika ei pruugi olla täpne, esinduslik ega muul moel investeringute, mille andmeid hinnatakse, tegelikke PAI väärtusi peegeldav ning see eeldab kaudselt, et nende väärtpaberite emitentide keskmine näitaja väärtus, kes andmeid esitavad, on esinduslik nende portfelli kuuluvate investeringute osas, mille kohta andmed puuduvad. Kvalitatiivsetel andmetel põhinevate PAI näitajate puhul tuvastab MSCI negatiivsed mõjud, kasutades andmeid, mille on esitanud investeerimisobjektiks olev ettevõtte või mis on esitatud tema kohta. Kui sellised andmed ei ole kättesaadavad, siis MSCI meetodika tõlgendab seda kui indikaatiivset (st mitte lõplikult ega tingimata täpselt) ebasoodsa mõju puudumist.

Andmed kõigi PAIde kohta olid kättesaadavad ligikaudu 79% kohta hallatavast portfelist ja need ei olnud kättesaadavad 21% kohta. MSCI on positsioonide osakaalu kättesaadavate andmete alusel ainult allpool toodud PAIde suhtes üle vaadanud, et hinnata positsioone, mille kohta kättesaadavaid andmeid ei ole.

Investeeringusobjektidesse tehtud investeeringutele kohaldatavad näitajad: 1. Kasvuhoonegaaside heitkogused, 2. Süsiniku jalajälg, 3. Investeeringusobjektide kasvuhoonegaaside heite intensiivsus, 5. Mittetaastuva energia tarbimine ja tootmine, 6. Energiatarbimise intensiivsus suure kliimamõjuga sektori kohta, 8. Vettehoid, 9. Ohtlike jäätmete ja radioaktiivsete jäätmete suhe, 12. Korrigeerimata sooline palgalõhe, 13. Juhatuse sooline mitmekesisus

Riiklikesse ja riigiülelitesse üksustesse tehtud investeeringutele kohaldatavad näitajad: 15. Kasvuhoonegaaside heite intensiivsus

Täiendavad sotsiaalsed ja töötajate, inimõiguste austamise, korrupsiooni- ja altkäemaksuvastase võitlusega seotud näitajad: 23. Keskmine poliitilise stabiilsuse hinne

Käesolevas aruandes jätab MSCI raha, raha ekvivalendid ja mis tahes muud varaliigid / tehingud nagu tuletisinstrumendid (raha) „kõigi investeeringute väärtusest“ välja (see on nimetaja näitaja, mida kasutatakse teatavate PAI parameetrite arvutamiseks (nt kasvuhoonegaaside heitkogused)). CIM on seisukohal, et tema portfelliges hoitavat sularaha ei kasutata otseselt ega kaudselt investeeringusobjektideks olevatesse ettevõtetesse/riikidesse tehtavate „investeeringute“ rahastamiseks, vaid pigem investimisega mitteseotud eesmärkidel ja portfelli tõhusaks haldamiseks ning seega ei tohiks see tähendada „kõiki investeeringuid“. CIM leiab ka, et sularaha väljajätmine on konservatiivsem lähenemisviis, kuna see muudab nimetaja näitaja väiksemaks ja seega ka PAIde üldhinded suuremaks.

CIM vaatab pidevalt oma protsessid ja juhtimisraamistikud üle, et tagada nende vastavus praeguste parimatele tavadele, ning selle lähenemisviisiga seoses võib CIM õigel ajal üle vaadata PAI aruandes järgitud lähenemisviisi (ühes või mitmes punktis).

Oluline teave

Citi Private Bank suhtub teie andmete kaitsmisse täie tõsidusega. Lisateabe saamiseks külastage meie veebisaiti:

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

Citibank Europe plc, Luxembourg Branch, mis on registreeritud Luksemburgi kaubandus- ja äriregistris numbri B 200204 all, on Citibank Europe plc filiaal. Ta on Euroopa Keskpanka ja Iirimaa Keskpanka ühise järelevalve all. Lisaks sellele kohaldatakse tema suhtes piiratud reguleerimist Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) kui vastuvõtva liikmesriigi ametiasutuse poolt ja ta on registreeritud CSSFis numbri B00000395 all. Tema kontor asub aadressil 31, Z.A. Bourmicht, 8070 Bertrange, Luksemburgi Suurhertsogiriik.

Citibank Europe plc tegevust reguleerib Iirimaa Keskpank. Ta on kantud keskpanka registrisse viitenumbri C26553 ja tema üle teostab järelevalvet Euroopa Keskpank. Tema registrijärgne asukoht on 1 North Wall Quay, Dublin 1, Iirimaa. Citibank Europe plc on registreeritud Iirimaa, tema registreerimisnumber on 132781. Teda reguleerib Iirimaa keskpank viitenumbri C26553 all.

© 2023 Citigroup Inc. Kõik õigused kaitstud. Citi ja Citi with Arc Design on Citigroupi või selle sidusettevõtete registreeritud teenindusmärgid.