

## **Rapport Article 29 Loi Energie-Climat Exercice 2023**

En vertu de l'article 29 de la Loi n° 2019-1147 du 8 novembre 2019 relative à l'énergie et au climat Energie-Climat sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (la "LEC"), Citadel France ("Citadel France") est tenue de mettre à disposition de ses souscripteurs et du public un document retraçant leur politique sur la prise en compte dans leur stratégie.

Citadel France SAS est une entreprise d'investissement agréée et supervisée par l'Autorité de contrôle prudentiel et de résolution ("ACPR") et l'Autorité des Marchés Financiers ("AMF"), dans le cadre de la Directive MIFID II, pour la fourniture des services de gestion de portefeuille pour compte de tiers et de conseil en investissement.

Au cours de l'exercice 2023, Citadel France a fourni un service de gestion de portefeuille à un client unique, Citadel Advisors LLC, une société de gestion de Citadel et enregistrée en qualité d'*investment advisor* auprès de la U.S. Securities and Exchange Commission

Citadel France n'agit pas comme conseiller financier au sens du Règlement (UE) 2019/588 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (« SFDR »).

### **A. Démarche générale sur la prise en compte des critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance (« ESG »)**

#### *A.1. Démarche*

L'objectif principal de Citadel France est d'obtenir des taux de rendement élevés et constants, ajustés au risque, pour les portefeuilles de ses clients. Citadel France est habilitée, dans le cadre du mandat de gestion de portefeuille conclu avec son client, à effectuer des opérations sur divers instruments financiers, en mettant principalement l'accent sur les stratégies de *Fixed Income*.

Les portefeuilles gérés par Citadel France ne visent ni à promouvoir une ou plusieurs caractéristiques ESG (aux fins de l'article 8 de SFDR) et ni un investissement durable ou la réduction des émissions de carbone (aux fins de l'article 9 de SFDR). Citadel France peut, si le gérant de portefeuille concerné le juge approprié, prendre en compte l'impact potentiel des facteurs ESG sur la performance financière prospective d'un investissement proposé, mais n'est pas tenu de le faire. Dans la mesure où Citadel France estime que des facteurs ESG sont pertinents, elle les prendra en compte dans le processus de décision d'investissement.

#### *A.2. Contenu, fréquence et moyens utilisés pour informer les souscripteurs, affiliés, cotisants, allocataires ou clients sur les critères relatifs aux objectifs ESG pris en compte dans la politique et la stratégie d'investissement*

Les stratégies d'investissement de Citadel France sont principalement axées sur des stratégies de *Fixed Income* et *Macro* ne comportent pas d'objectifs ESG explicites.

#### *A.3. Adhésion de l'entité, ou de certains produits financiers, à une charte, un code, une initiative ou obtention d'un label sur la prise en compte de critères ESG ainsi qu'une description sommaire de ceux-ci*

Citadel France n'adhère pas à ce jour à aucune charte, code ou initiative sur la prise en compte de critères ESG.

**B. Liste des produits financiers mentionnés en vertu de l'article 8 et 9 du Règlement (UE) 2019/2088 du Parlement Européen et du Conseil du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR)**

N/A - Au cours de l'année 2023, tous les portefeuilles gérés par Citadel France relèvent de l'article 6 de SFDR