

Rapport Article 29

Loi Énergie-Climat

Exercice 2025

**STRUCTURE DE L'INFORMATION EN MATIERE DE DURABILITE DU RAPPORT ANNUEL CONFORMEMENT AU V
DE L'ARTICLE D.533-16-1 DU CODE MONETAIRE ET FINANCIER, POUR LES ENTITES DONT LE BILAN OU LES
ENCOURS SONT SUPERIEURS A 500 MILLIONS D'EUROS, NON SOUMISES AUX OBLIGATIONS DE PUBLICATION
DE L'ARTICLE 4 DU REGLEMENT (UE) 2019/2088 DU PARLEMENT EUROPEEN ET DU CONSEIL DU 27
NOVEMBRE 2019**

En application de l'article 29 de la loi n° 2019-1147 du 8 novembre 2019 relative à l'énergie et au climat (la « **LEC** »), Citadel France (« **Citadel France** ») est tenue de publier un document présentant sa politique d'intégration des considérations de durabilité dans sa stratégie d'investissement.

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** ») au titre de la directive MiFID II, pour la fourniture de services de gestion de portefeuille pour le compte de tiers et de conseil en investissement.

Au cours de l'exercice 2025, Citadel France a fourni des services de gestion de portefeuille à un client unique, Citadel Advisors LLC, une société de gestion du groupe Citadel enregistrée en qualité de *conseiller en investissement* auprès de la U.S. Securities and Exchange Commission.

Citadel France n'agit pas en qualité de conseiller financier au sens du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (« **SFDR** »).

A. Approche générale de la prise en compte des critères de qualité environnementaux, sociaux et de gouvernance

Les entités soumises aux obligations de publication de l'article 29 de la LEC fournissent les informations prévues aux a), b) et e) du 1° du III de l'article D. 533-16-1 du Code monétaire et financier.

L'objectif principal de Citadel France est de générer des rendements ajustés au risque élevés et constants pour les portefeuilles de son client. Dans le cadre du mandat de gestion de portefeuille conclu avec son client, Citadel France est autorisée à effectuer des opérations sur divers instruments financiers, avec un accent principal sur les stratégies Taux.

Les portefeuilles gérés par Citadel France ne promeuvent pas de caractéristiques ESG (au sens de l'article 8 du SFDR) et ne constituent pas des investissements durables ni ne visent la réduction des émissions de carbone (au sens de l'article 9 du SFDR). Citadel France peut, à la discrétion du gérant de portefeuille concerné, prendre en compte l'impact potentiel des facteurs ESG sur la performance financière prévisionnelle d'un investissement envisagé, sans y être toutefois tenue.

B. Moyens internes déployés par l'entité

Les entités soumises aux obligations de publication de l'article 29 de la LEC fournissent les informations prévues au 2° du III de l'article D. 533-16-1 du Code monétaire et financier.

Les portefeuilles gérés par Citadel France ne promeuvent pas de caractéristiques ESG (article 8 du SFDR) et ne poursuivent pas d'objectifs d'investissement durable ni de réduction des émissions de carbone (article 9 du SFDR). En conséquence, Citadel France ne dispose pas de ressources dédiées aux critères ESG au sein de ses stratégies d'investissement.

C. Approche de la prise en compte des critères de qualité environnementaux, sociaux et de gouvernance au niveau de la gouvernance de l'entité

Les entités soumises aux obligations de publication de l'article 29 de la LEC fournissent les informations prévues au 3° du III de l'article D. 533-16-1 du Code monétaire et financier.

Les stratégies d'investissement de Citadel France sont principalement axées sur les stratégies Taux et Macro, incluant la dette souveraine et les instruments associés, et n'investissent pas dans des produits actions ou obligations convertibles.

En conséquence, Citadel France ne met pas en œuvre d'approche de prise en compte des critères ESG au niveau de la gouvernance.

D. Stratégie d'engagement avec les émetteurs ou les sociétés de gestion

Les entités soumises aux obligations de publication de l'article 29 de la LEC fournissent les informations prévues au 4° du III de l'article D. 533-16-1 du Code monétaire et financier.

Les stratégies d'investissement de Citadel France sont principalement axées sur les stratégies Taux et Macro, incluant la dette souveraine et les instruments associés.

En conséquence, Citadel France ne dispose pas de stratégie d'engagement avec les émetteurs au titre de la présente réglementation.

E. Taxonomie européenne et énergies fossiles

Les entités soumises aux obligations de publication de l'article 29 de la LEC fournissent les informations prévues au 5° du III de l'article D. 533-16-1 du Code monétaire et financier.

Les stratégies d'investissement de Citadel France sont principalement axées sur les stratégies Taux et Macro, incluant la dette souveraine et les instruments associés.

En conséquence, aucune partie des actifs gérés sous délégation de son client unique n'est investie dans des entreprises actives dans le secteur des énergies fossiles au sens de l'acte délégué pertinent pris en application de l'article 4 dudit règlement.

F. Stratégie d'alignement avec les objectifs de l'Accord de Paris

Les entités soumises aux obligations de publication de l'article 29 de la LEC fournissent les informations prévues au 6° du III de l'article D. 533-16-1 du Code monétaire et financier.

Les stratégies d'investissement de Citadel France sont principalement axées sur les stratégies Taux et Macro, incluant la dette souveraine et les instruments associés.

Compte tenu de la nature des instruments dans lesquels elle investit, Citadel France ne publie pas de stratégie d'alignement avec les objectifs à long terme des articles 2 et 4 de l'Accord de Paris relatifs à l'atténuation des émissions de gaz à effet de serre, ni avec la stratégie nationale bas-carbone mentionnée à l'article L. 222-1 B du Code de l'environnement.

G. Stratégie d'alignement avec les objectifs à long terme en matière de biodiversité

Les entités soumises aux obligations de publication de l'article 29 de la LEC fournissent les informations prévues au 7° du III de l'article D. 533-16-1 du Code monétaire et financier.

Les stratégies d'investissement de Citadel France sont principalement axées sur les stratégies Taux et Macro, incluant la dette souveraine et les instruments associés, qui ne comportent pas d'objectifs explicites liés à la biodiversité.

H. Approche de l'intégration des critères de qualité ESG dans la gestion des risques, y compris les risques physiques, de transition et de responsabilité liés au changement climatique et à la biodiversité

Les entités soumises aux obligations de publication de l'article 29 de la LEC fournissent les informations prévues aux 8° et 8° bis du III de l'article D. 533-16-1 du Code monétaire et financier.

Les stratégies d'investissement de Citadel France sont principalement axées sur les stratégies Taux et Macro, incluant la dette souveraine et les instruments associés, qui ne comportent pas d'objectifs explicites liés aux



critères ESG, y compris en ce qui concerne les risques physiques, de transition et de responsabilité liés au changement climatique et à la biodiversité.

I. Produits financiers relevant des articles 8 et 9 du SFDR

N/A - Au cours de l'exercice 2025, les portefeuilles gérés par Citadel France relevaient de l'article 6 du SFDR.

Juin 2026