

Informații referitoare la durabilitate

Numele produsului: Fondul deschis de investiții OTP Innovation

Clasificare în baza Regulamentului UE nr. 2088/2019: art. 8

LEI: 549300JUL0CWJG9HLS59

Sinteză

Fară obiective de investiții durabile

Acest produs financiar promovează caracteristici de mediu sau sociale, dar nu are ca obiectiv realizarea de investiții durabile.

Caracteristici de mediu și/sau sociale ale acestui produs financiar

Caracteristicile promovate de către acest produs financiar constau în formarea unui portofoliu de instrumente financiare a cărui risc de durabilitate să fie unul scăzut, fiind excluse investițiile în instrumente financiare care au legătură cu arme controversate, inclusiv arme nucleare, biologice, chimice, arme laser orbitoare, mine antipersonal, muniții cu dispersie, fragmente nedetectabile și alte arme care sunt fie interzise de dispozițiile legale internaționale, fie considerate controversate datorită prejudiciului și/sau suferința disproporționată pe care le cauzează, în emisiuni de obligațiuni guvernamentale ale guvernelor supuse unor sancțiuni generale sau ale guvernelor care nu respectă drepturile omului conform reglementărilor internaționale precum și în instrumente emise de emitenți care au o performanță ESG slabă și un grad insuficient de transparență în divulgarea publică a datelor ESG materiale (grad de risc al durabilității ridicat).

Strategia de investiții ale acestui produs financiar

Strategia de investiții a fondului este una flexibilă și va urmări diversificarea portofoliului în vederea dispersiei riscului. Activele fondului fiind investite preponderent în acțiuni ale companiilor românești sau străine care alocă o pondere importantă din veniturile lor în domeniul cercetării și dezvoltării (R&D). Fondul intenționează să aibă un portofoliu diversificat sectorial, astfel investițiile vor fi îndreptate înspre companii din sectoare diverse de activitate cum ar fi cel tehnologic, biofarmaceutic, comerț electronic, autovehicule, etc. Prin strategia investițională fondul își propune să investească în acele companii care alocă bugete importante (raportate la cifra de afaceri) în finanțarea programelor de cercetare și dezvoltare raportate la sectorul lor de activitate.

Proporția investițiilor

În schema de mai jos este prezentată alocarea strategică, pe termen lung, a fondului din punct de vedere a alinierii cu criteriile E/S.



Monitorizarea caracteristicilor de mediu sau sociale

Administratorul de fond integrează în procesul decizional al selecției instrumentelor financiare incluse în portofoliul fondului criteriile ESG în conformitate cu politicile administratorului. Obiectivul administratorului de fond este ca profilul agregat de risc de durabilitate a fondului să se mențină în clasa de risc scăzut.

În condițiile în care profilul de risc agregat de durabilitate al fondului iese din clasa de risc scăzut, administratorul de fond va întreprinde măsuri de rebalansare pentru a se reîncadra în profilul de risc de durabilitate scăzut, într-un orizont de timp rezonabil, urmărind în același timp obiectivul de a nu prejudicia investitorii fondului.

Metodologii

INNO Investments SAI SA (INNO) folosește evaluările și scorurile ESG furnizate de un furnizor extern de date.

Furnizorul extern de date calculează expunerea fiecărei companii la riscurile ESG cheie pe baza unei defalcări granulare a activității unei companii: produsul sau segmentele sale de afaceri de bază, locațiile activelor sau

veniturilor sale și alte măsuri relevante, cum ar fi producția externalizată. Analiza ia apoi în considerare măsura în care o companie a dezvoltat strategii robuste și a demonstrat un istoric solid de performanță în gestionarea nivelului său specific de riscuri sau oportunități. Controversele în curs sau structurale apărute în ultimii trei ani duc la o scădere din scorul general al managementului pentru fiecare problemă.

Surse de date și prelucrarea datelor

În cazul în care un instrument financiar care nu are un scor de risc de durabilitate oferit de furnizorii externi de date, scorul său de risc de durabilitate poate fi determinat pe baza datelor disponibile publicului, cum ar fi Lista de clasificare a riscurilor de mediu și sociale publicată și revizuită de Banca Europeană pentru Reconstrucție și Dezvoltare (BERD) și disponibilă pe site-ul său web.

Limitări ale metodologiilor și a datelor

Este posibil ca anumite elemente din portofoliul fondului să fie reprezentate de instrumente financiare ale căror ratinguri nu pot fi determinate (de exemplu, instrumente derivate, conturi curente și depozite bancare, alte instrumente ale pieței monetare, alte valori mobiliare care nu pot fi încadrate în riscurile de durabilitate, etc), aceste elemente de portofoliu sunt ignorate și INNO determină categoria de risc de durabilitate pe baza ratingurilor ESG ale instrumentelor financiare rămase.

Obligația de diligență

Având în vedere convingerea că factorii ESG pot afecta performanța și profilul de risc al investițiilor, conducerea INNO încearcă să înțeleagă impactul riscurilor legate de ESG. Integrarea și gestionarea riscurilor și oportunităților de durabilitate este în primul rând responsabilitatea managerului de portofoliu. Persoana responsabilă cu managementul riscului are responsabilitatea de a gestiona riscurile identificate de durabilitate prin supraveghere și implicare când nivelurile de risc de durabilitate depășesc nivelul de risc de durabilitate al Fondului.

Politici de implicare

INNO se angajează să evalueze riscurile și oportunitățile ESG ale companiilor în care intenționează să investească sau a investit deja. INNO susține durabilitatea prin politica sa de implicare care se regăsește pe site-ul web al societății.

Criteriu de referință desemnat

N/A – Acest fond este administrat activ și nu are desemnat un indice de referință.