

INFORMAȚII PRIVIND CERINȚELE DE TRANSPARENȚĂ ȘI PUBLICARE, ÎN CONFORMITATE CU PREVEDERILE REGULAMENTULUI A.S.F. NR. 9/2019 2021

1. STRUCTURA ORGANIZATORICĂ A OTP ASSET MANAGEMENT ROMÂNIA SAI SA

Structura organizatorică a societății este stabilită în conformitate cu legislația în vigoare aplicabilă pieței de capital. (Anexa 1)

2. COMPONENTA STRUCTURILOR DE CONDUCERE

OTP Asset Management România SAI SA este o societate pe acțiuni administrată în sistem dualist. Conducerea societății este asigurată de către **Directorat** format din 3 membri numiți în conformitate cu Actul Constitutiv al Societății și al legislației în vigoare, și anume :

Nume	Funcție
Dan Marius Popovici	Președinte Directorat/ Director General
Manolescu Dragoș-Gabriel	Membru Directorat/ Director General Adjunct
Adrian Anghel	Membru Directorat/ Director General Adjunct

Conducători ai Societății în conformitate cu prevederile Ordonanței nr. 32/2012 sunt membrii Directorat.

Consiliul de Supraveghere al OTP Asset Management România SAI SA este format din 3 membri:

Nume	Funcție
Gáti László György	Președinte
Molnár Erzsébet Tünde	Membru
Corina Elena Stoica	Membru

3. PRINCIPALELE CARACTERISTICI ALE SISTEMULUI DE GUVERNANȚĂ



Societatea asigură aplicarea unui sistem de guvernanță corporativă în vederea administrării corecte, eficiente și prudente, bazată pe principiul continuității activității, aplică sisteme de guvernanță corporativă precum: asigurarea unei structuri organizatorice transparente și adecvate, alocarea corectă și separarea corespunzătoare a responsabilităților, administrarea eficientă a riscurilor, adecvarea politicilor și a strategiilor, precum și a mecanismelor de control intern, aplicarea unor proceduri operaționale solide care să împiedice divulgarea de informații confidențiale, crearea unui sistem eficient de comunicare și de transmitere a informațiilor

- Structura organizatorică este construită cu respectarea prevederilor legale în vigoare, reflectă în mod clar și documentat structurile ierarhice de raportare, permite minimizarea riscului unui conflict de interese.
- În activitatea desfășurată societatea respectă următoarele principii generale:
 - Are stabilită și menține o structură organizatorică în care sunt specificate nivelurile ierarhice, funcțiile și responsabilitățile sunt repartizate în mod clar, astfel încât să se respecte principiul separării și independenței funcțiilor;
 - Stabilește și menține un sistem intern eficient de raportare și comunicare a informațiilor, precum și schimburi de informații;
 - Aplica și menține un sistem intern eficient de raportare și comunicare a informațiilor;
 - Păstrează o evidență adecvată și ordonată a operațiunilor efectuate și a organizării interne;

4. CONCLUZIILE EVALUĂRII POZIȚIEI FINANCIARE AVÂND LA BAZĂ SITUAȚIILE FINANCIARE AUDITATE PE ANUL 2021

- În exercitiul financiar 2021 s-a înregistrat un profit net de 1.312.524 lei;
- Activele sub administrare la data de 31.12.2021, calculate în conformitate cu prevederile legale în vigoare, sunt în sumă de 792.562.278,33 Lei. – conform Anexei 2
- OTP AMR avea o cotă de piață în cadrul pieței fondurilor deschise de Investiții la data de 31.12.2021, determinată în funcție de valoarea activelor administrate ale membrilor A.A.F. în fonduri deschise de Investiții (UCITS), de 3.13 %, ceea ce o situa pe locul 6 în rândul societăților de administrare a investițiilor din România.

5. PRINCIPALELE CARACTERISTICI ALE CADRULUI FORMAL PRIVIND APLICAREA PRINCIPIILOR DE RAPORTARE FINANCIARĂ, INCLUSIV CELE DE RAPORTARE PRUDENȚIALĂ

În cazul raportărilor proprii, societatea operează în conformitate cu prevederile Actului Constitutiv și ale reglementărilor legale în vigoare.

În cazul fondurilor deschise de investiții pe care le administrează, societatea operează în conformitate cu documentele de constituire ale fondurilor și ale reglementărilor legale în vigoare.

Funcția de contabilitate este externalizată către EXPERT LEX SOLUTIONS SRL cu sediul în București, str. Branduselor nr. 2-4, Clădirea Vitan Business Center, Et. 7, Intr. 26, Cam. 3, Biroul 1, sector 3, înmatriculată la Registrul Comerțului sub numărul J40/9936/2009, Cod Unic de Înregistrare 26068719, autorizată CAFR nr. 6690/30.10.2009 reprezentată prin d-na Gabriela Tudor, în calitate de Administrator..

Politicile contabile au fost elaborate astfel încât să asigure furnizarea, prin situațiile financiare anuale ale societății și entităților administrate, a unor informații care să fie:

- a) inteligibile, în sensul de a fi ușor de înțeles de utilizatori;
- b) relevante pentru nevoile utilizatorilor în luarea deciziilor;
- c) credibile, în sensul că: reprezintă fidel rezultatele și poziția financiară a societății, reflectă substanța economică a evenimentelor și tranzacțiilor și nu doar forma juridică, sunt neutre, prudente, complete, sub aspectele semnificative;
- d) comparabile, pentru a compara în timp situațiile financiare.

Situațiile financiare sunt întocmite pe baza principiului continuității activității în viitorul previzibil.

Situațiile financiare ale societății și ale entităților administrate, sunt întocmite în conformitate cu Standardele Internaționale de Raportare Financiară (IFRS) și cu reglementările ASF în vigoare.

Responsabilitățile structurilor organizatorice ale societății implicate de aplicarea principiilor și practicilor de raportare financiară, inclusiv cele de raportare prudentțială:

➤ **Conducerea Societății** este responsabilă de asigurarea existenței unui cadru adecvat de verificare a modului în care se aplică legislația specifică privind raportarea către A.S.F., precum și a informațiilor transmise către A.S.F., la solicitarea acesteia, privind anumite acțiuni întreprinse de Societate.

➤ **Comitetul de Audit:**

- monitorizează procesul de raportare financiară
- monitorizează eficacitatea sistemelor de control intern, de audit intern, de management al riscurilor din cadrul entității;
- monitorizează auditarea situațiilor financiare individuale anuale;
- verifică și monitorizează independența auditorului financiar, în special în legătură cu prestarea de servicii suplimentare către entitate;

➤ **Directorul de Conformitate** este responsabil cu monitorizarea și verificarea cu regularitate a aplicării prevederilor legale incidente activității societății și a regulilor și procedurilor interne.

➤ **Auditul Intern** evaluează modul în care sunt respectate dispozițiile cadrului legal, Reglementările interne, precum și modul în care sunt implementate politicile și procedurile Societății și dacă este cazul, propune modificările necesare;

➤ **Administratorul de Risc** este responsabil cu monitorizarea și gestionarea riscurilor aferente activității desfășurate de către societate atât în nume propriu cât și în numele fondurilor de investiții administrate .

6. PRINCIPALELE CARACTERISTICI ALE SISTEMULUI DE ADMINISTRARE/MANAGEMENT AL RISCULUI

Politicile și activitățile de management al riscului în cadrul OTP Asset Management Romania SAI SA sunt create conform celor mai bune practici în domeniu și se concentrează asupra anticipării și identificării, cât mai rapid posibil, a evaluării și monitorizării riscurilor.

Principalele obiective ale Sistemului de management al riscului se referă pe de o parte la gestionarea cât mai eficientă a riscurilor la care sunt expuse fondurile administrate, iar pe de altă parte la gestionarea riscurilor societății într-un mod cât mai eficient pentru a se încadra în nivelul de risc acceptat.

Unul dintre elementele centrale ale sistemului de management al riscului este funcția permanentă de administrare a riscului, administrată funcțional și ierarhic de către Serviciul de administrare a riscului.

Funcția de administrare a riscului, este ierarhic și funcțional independentă de celelalte compartimente ale Societății și raportează direct către Directorat și Consiliul de Supraveghere.

Principalele riscuri asociate investițiilor financiare sunt riscul de piață, riscul de lichiditate, riscul de credit, riscul de durabilitate și riscul operațional.

Pentru fiecare dintre riscurile la care este expusă “Societatea” și entitățile administrate a fost creat și implementat un sistem de indicatori și limite în funcție de tipul de risc, indicatori ce sunt calculați și monitorizați cu o frecvență stabilită prin politicile de risc, astfel încât orice depășire a limitelor de risc stabilite să fie cât mai curând identificată pentru a se lua măsuri în vederea reîncadrării în limite.

7. EXTRAS PRIVIND CONCLUZIILE EVALUĂRII EFICIENȚEI SISTEMULUI DE ADMINISTRARE/MANAGEMENT AL RISCULUI –2021

Politicile OTP Asset Management România SAI SA privind managementul și administrarea riscului au fost revizuite pe parcursul anului 2021;

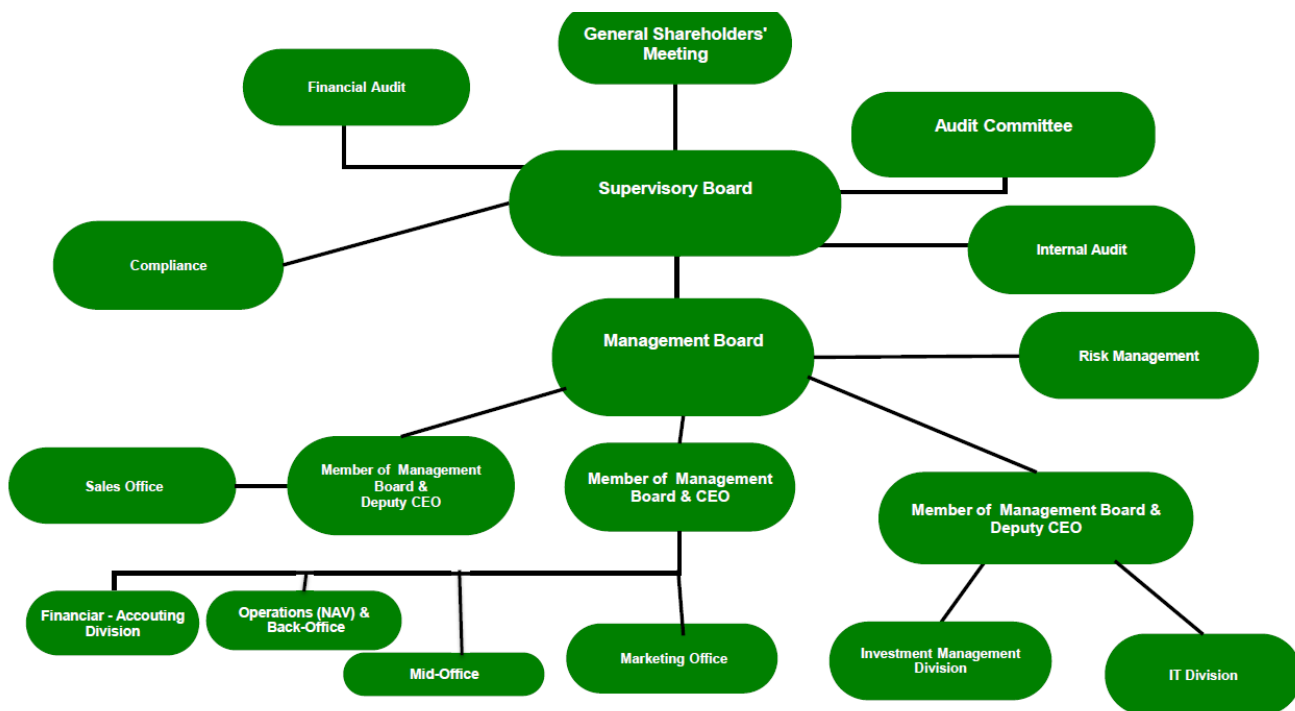
➤ Pe parcursul anului 2021 au fost efectuate teste de stress privind impactul anumitor riscuri asupra portofoliilor fondurilor deschise de investiții administrate. Pe lângă scenariile utilizate în mod obișnuit, au fost proiectate scenarii specifice anumitor mișcări din piață (ex. creșterea ratelor de dobândă) și pe baza acestora sau efectuat noi teste de stress.

➤ Conform “Politicii privind simularea situațiilor de criză de lichiditate pentru OPCVM-urile administrate de către OTP Asset Management Romania SAI SA”. se efectuează trimestrial teste de stress de lichiditate.

- Pe parcursul anului 2021 nu s-au înregistrat depășiri importante ale limitelor de risc stabilite; Au fost depășiri ale limitelor investiționale stabilite prin reglementările legale, care au fost remediate în cel mai scurt timp.
- A fost actualizat planul de continuare a activității și recuperare în caz de dezastru; Având în vedere evoluția pandemiei Covid-19 în anul 2021, toate măsurile implementate în anul 2020 au fost păstrate și pe parcursul anului 2021.
- Pe parcursul anului 2021 au fost efectuate simulări de criză pentru verificarea planurilor de continuare a afacerii, de recuperare în caz de dezastru și de răspuns la incidente de securitate informatică.
- Pe parcursul anului 2021 nu s-au înregistrat evenimente importante de risc operațional care să conducă la pierderi semnificative pentru “Societate”, entitățile administrate sau clienți.

8. ANEXE

ANEXA 1 – ORGANIGRAMA OTP ASSET MANAGEMENT ROMÂNIA SAI SA – la 31.12.2021



ANEXA 2 – SITUAȚIA FONDURILOR DESCHISE DE INVESTIȚII ADMINISTRATE LA DATA DE 31.12.2021

Denumire Fond	Valuta	Numar investitori	Valoarea activului net (RON)
OTP AvantisRO - Clasa E	EUR	208	13.522.141,79
OTP AvantisRO - Clasa L	RON	1.337	70.772.806,72
OTP ComodisRO	RON	4.294	147.974.282,50
OTP Dinamic - Clasa E	EUR	111	8.884.175,74
OTP Dinamic - Clasa L	RON	197	4.300.363,02
OTP Dollar Bond	USD	217	29.059.973,81
OTP Euro Bond	EUR	1.109	136.803.521,33
OTP Expert	RON	1	44.513.143,32
OTP Global Mix - Clasa E	EUR	327	20.893.161,09
OTP Global Mix - Clasa L	RON	1.858	51.330.797,03
OTP Obligatiuni - Clasa I	RON	6	49.162.451,13
OTP Obligatiuni - Clasa R	RON	3.119	134.176.117,19
OTP Premium Return - Clasa E	EUR	177	10.965.045,48
OTP Premium Return - Clasa L	RON	837	27.476.028,57
OTP Real Estate & Construction - Clasa E	EUR	126	9.837.503,66
OTP Real Estate & Construction - Clasa L	RON	450	32.890.765,94
TOTAL ACTIVE ADMINISTRATE			792.562.278,33