

Transparența politicilor privind riscurile legate de durabilitate

Prezenta declarație este elaborată în acord cu prevederile art.3, alin.(1), din Regulamentul (UE) 2019/2088 al Parlamentului European și al Consiliului din data de 27.11.2019 privind informațiile privind durabilitatea în sectorul serviciilor financiare¹.

Regulamentul 2019/2088 stabilește pentru participanții la piața financiară și consultanții financiari norme privind transparența în legătură cu integrarea riscurilor legate de durabilitate și luarea în considerare a efectelor negative asupra durabilității în cadrul activităților lor și privind furnizarea informațiilor privind durabilitatea în ceea ce privește produsele financiare.

BRD Asset Management S.A.I., prin calitatea sa de societate de administrare a unor organisme de plasament colectiv în valori mobiliare (OPCVM), este participant la piața financiară.

Factorii de durabilitate se referă la aspecte de mediu, sociale și cele legate de forța de muncă, respectarea drepturilor omului, chestiunile legate de combaterea corupției și dării de mită.

Riscul legat de durabilitate înseamnă un eveniment sau o condiție de mediu, socială sau de guvernare care, în cazul în care se produce, ar putea cauza un efect negativ semnificativ, efectiv sau potențial, asupra valorii investiției.

Prin activitatea de investiții desfășurată, participanții la piața financiară pot genera, în mod direct sau indirect impact asupra mediului sau comunității. Întrucât aspectele de mediu sau de natură socială pot reprezenta riscuri pentru participanții la piața financiară, există un interes crescut pentru identificarea, evaluarea, prevenirea și/sau atenuarea acestora, dar și pentru identificarea unor oportunități de investiții cu impact pozitiv, ca parte integrantă a strategiei de responsabilitate socială.

BRD Asset Management S.A.I. face parte dintr-un Grup cu preocupări constante privind aspectele de mediu, sociale, etice și de guvernare, acestea reflectându-se și în modul de selecție a clienților și furnizorilor de servicii. Mai mult, investițiile responsabile, bazate fie pe principii de excludere sau pe existența anumitor restricții, evoluează înspre a deveni parte integrantă a strategiei de responsabilitate socială.

Materializarea riscurilor legate de durabilitate poate avea un impact asupra instrumentelor financiare pe termen mediu și lung. Direcția Investiții a BRD Asset Management S.A.I. va avea în vedere aceste aspecte în luarea deciziilor de investiții pentru a optimiza raportul dintre randament și risc, dar ele sunt complementare evaluărilor consacrate din domeniul financiar. Având în vedere caracterul diversificat al

¹ **Articolul 3, alin.(1)** - *Participanții la piața financiară publică pe site-urile lor internet informații despre politicile privind integrarea riscurilor legate de durabilitate în procesele lor de luare a deciziilor privind investițiile.*

BRD ASSET MANAGEMENT S.A.I S.A.

Str. Dr. Nicolae Staicovici, nr.2, Opera Center II, etaj 5, sector 5, cod poștal 050558, București, România
Tel: + 4021-327.22.28/ 321.20.12; Fax: + 4021-327.14.10; e-mail: brdamoffice@brd.ro; <http://www.brdam.ro>
Capital social: 4.000.000 lei; Nr. Reg. Comerțului J40/7066/2000; Cod unic de înregistrare 13236071;
Aut.A.S.F. - Decizia nr.527/30.03.2001; Nr. Registru A.S.F. PJR05SAIR/400010/26.02.2003
Notificare înscrisă în registrul de evidență a prelucrărilor de date cu caracter personal sub nr. 23680

portofoliului Fondurilor Administrate, acestea vor fi expuse unei varietăți de riscuri legate de durabilitate, care diferă de la un emitent la altul. Totuși, considerând diversificarea, materializarea unui singur risc legat de durabilitate nu ar trebui să afecteze semnificativ valoarea portofoliului unui Fond Administrat.

Pentru reducerea riscurilor de durabilitate ale Fondurilor Administrate, sunt utilizate diverse instrumente, precum:

Criteriile de excludere: aceste criterii se referă la un tip de activitate a unui emitent sau la un tip de activ sau proiect. În cele mai multe cazuri, criteriul se verifică pe baza informațiilor care descriu activitatea emitentului. În cazul nealinierii cu criteriul de excludere, nu sunt permise tranzacții cu anumite categorii de active/emitenți. În cazul nealinierii cu criteriul de excludere pentru un emitent, interdicția de investiții se regăsește la nivelul oricărui activ emis de acesta.

Listele de excludere puse la dispoziție de Grupul din care BRD Asset Management S.A.I. face parte cuprind 3 secțiuni: sectorul apărării, țări, emitenți. Fiecare listă cuprinde:

- Lista companiilor care trebuie excluse pentru nerespectarea criteriilor de excludere din Politicile Grupului;
- Lista de activități/țări care reflectă criteriile de excludere stabilite în Politicile Grupului.

Listele de identificare puse la dispoziție de Grupul din care BRD Asset Management S.A.I. face parte au rol în identificarea companiilor, proiecte sau tipuri de activități (în anumite regiuni sau la nivelul mondial) pentru care a fost identificat un potențial risc de mediu sau social (risc E&S). Această identificare se bazează pe:

- Cartografierea riscurilor de mediu sau sociale care ar putea impacta anumite activități/regiuni;
- Surse externe pentru identificarea riscurilor E&S;
- Un grup de companii identificate ca neconforme cu Pactul Global al ONU este inclus în lista de identificare E&S;
- Proiectele, companiile în care este implicat direct Grupul Societe Generale sunt, de asemenea, incluse în lista de identificare E&S atunci când acestea implică un risc reputațional potențial ridicat.

Dacă în cadrul procesului de monitorizare continuă a emitenților sunt identificate elemente care evidențiază un risc ridicat legat de durabilitate, acestea sunt aduse în atenția Comitetului de Investiții.

BRD ASSET MANAGEMENT S.A.I S.A.

Str. Dr. Nicolae Staicovici, nr.2, Opera Center II, etaj 5, sector 5, cod poștal 050558, București, România
Tel: + 4021-327.22.28/ 321.20.12; Fax: + 4021-327.14.10; e-mail: brdamoffice@brd.ro; <http://www.brdam.ro>
Capital social: 4.000.000 lei; Nr. Reg. Comerțului J40/7066/2000; Cod unic de înregistrare 13236071;
Aut.A.S.F. - Decizia nr.527/30.03.2001; Nr. Registru A.S.F. PJR05SAIR/400010/26.02.2003
Notificare înscrisă în registrul de evidență a prelucrărilor de date cu caracter personal sub nr. 23680