

INFORMAȚII PRIVIND CERINȚELE DE TRANSPARENTĂ ȘI PUBLICARE, ÎN
CONFORMITATE CU PREVEDERILE REGULAMENTULUI A.S.F. NR. 2/2016

1. Structura organizatorică a SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT S.A.

Structura organizatorică a SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT S.A. (denumită în cele ce urmează „S.A.I.”) este implementată cu respectarea dispozițiilor prevăzute în legislația aplicabilă pieței de capital și face parte integrantă din Regulamentul de organizare și funcționare al societății.

- Adunarea Generală a Acționarilor
- Consiliul de Administrație
- Comitetul de Audit
- Directori
- Compartimentul de Conformitate
- Compartiment de Administrare a riscului
- Compartimente, conform organigramei (Anexa)

2. Componenta structurii de conducere

a) Consiliul de Administrație

Nume și prenume Funcția

BUCUR MARIAN Președinte
RAZVAN

IONELA VAITIS Membru

FLORIN ISAC Membru

b) Conducerea executivă

Nume și prenume Funcția

VALERIA AVRAM Director General

IONELA VAITIS Director General Adjunct

3. Principalele caracteristici ale sistemului de guvernare

Principiile de Guvernare Corporativă denumite în continuare „Guvernarea” sau „Principiile” aplicabile SAI Swiss Capital Asset Management SA reprezintă un set de

principii si recomandari in scopul aplicarii celor mai bune practici si realizarii unui management prudent in cadrul societatii.

Obiectivul acestor principii de guvernanta in cadrul SAI Swiss Capital Asset Management SA este de a asigura o administrare corecta, eficienta si prudenta bazata pe principiul continuitatii activitatii.

Scopul principiilor de guvernanta corporativa este acela de a se asigura ca SAI Swiss Capital Asset Management SA intruneste si respecta urmatoarele cerinte, fara a se limita la acestea:

- ✓ Asigura o structura organizatorica transparenta si adecvata;
- ✓ Responsabilitatile in cadrul SAI Swiss Capital Asset Management SA au o alocare adecvata si sunt separate corespunzator;
- ✓ Asigura un management al riscului corespunzator;
- ✓ Regulile, procedurile, politicile, strategiile si mecanismele de control intern ale SAI Swiss Capital Asset Management SA sunt adecvate;
- ✓ SAI Swiss Capital Asset Management SA asigura un sistem eficient de comunicare si de transmitere a informatiilor;
- ✓ Elaboreaza si aplica proceduri operationale solide pentru impiedicarea divulgarii informatiilor confidentiale.

4. Concluziile evaluării poziției financiare având la baza situațiile financiare auditate pe anul 2019

Auditorul financiar al SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA este Mazars Romania SRL iar pentru fondurile administrate este Expert AUDIT SRL.

În exercițiul financiar 2019 s-a înregistrat un profit brut în sumă de 6 471 588 lei și un profit net de 5 526 338 lei;

Activele la 31 decembrie 2019 pentru FDI ACTIV FDI DINAMIC calculate conform reglementărilor A.S.F. sunt în sumă de 18 414 236.48 lei.

Conform rapoartelor auditorilor financiari la 31.12.2019, situatiile financiare prezinta fidel, sub toate aspectele semnificative, pozitia financiara si performanta pentru exercitiul financiar si a fluxurilor de numerar pentru exercitiul financiar incheiat la 31.12.2019. Situatiile financiare la 31.12.2019 au fost intocmite in conformitate cu Norma ASF nr.39/2015 pentru aprobarea Reglementarilor contabile conforme cu Standardele Internationale de Raportare Financiara aplicabile entitatilor autorizate, reglementate si supravegheate de ASF si cu politicile contabile descrise in notele explicative la situatiile financiare.

5. Principalele caracteristici ale cadrului formal privind aplicarea principiilor și practicilor de raportare financiară, inclusiv cele de raportare prudentială

Situațiile financiare ale SAI SWISS CAPITAL Asset Management SA cât și ale fondurilor administrate sunt întocmite în conformitate cu Standardele Internaționale de Raportare Financiară (IFRS) și cu reglementările ASF în vigoare.

Politicile contabile au fost elaborate astfel încât să asigure furnizarea unor informații care **(1)** să reprezinte fidel rezultatele și poziția financiară a SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA și a fondurilor administrate, **(2)** să fie ușor de înțeles de utilizatori **(3)** relevante în luarea deciziilor precum și **(4)** comparabile, pentru a compara în timp situațiile financiare.

Structurilor organizatorice ale SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA implicate în aplicarea principiilor și practicilor de raportare financiară, inclusiv cele de raportare prudentială sunt:

Comitetul de audit (1) monitorizează procesul de raportare financiară; **(2)** monitorizează eficacitatea sistemelor de control intern, de audit intern, după caz, și de management al riscurilor din cadrul societății comerciale; **(3)** monitorizează auditul statutar al situațiilor financiare anuale; **(4)** verifică și monitorizează independența auditorului statutar sau a firmei de audit și, în special, prestarea de servicii suplimentare societății.

Consiliul de Administratie este responsabil 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 SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA.

Auditorul Intern evaluează modul în care sunt respectate dispozițiile cadrului legal, Reglementările interne, precum și modul în care sunt implementate politicile și procedurile SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA și dacă este cazul, propune modificările necesare.

Departamentul de conformitate supraveghează respectarea de către SAI SWISS CAPITAL AM SA și personalul acesteia a legislației în vigoare incidente pieței de capital, precum și a reglementărilor interne.

Departamentul de risc identifică, cuantifică și administrează riscurile relevante pentru SAI SWISS CAPITAL Asset Management SA și fondurile administrate

6. Principalele caracteristici ale sistemului de administrare /management a/al riscurilor

Societatea are implementat un set complet de proceduri și norme, referitoare la riscurile specifice activității desfășurate atât pentru SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA cât și pentru fondurile administrate, și un control riguros al costurilor pentru

menținerea unei poziții financiare adecvate, cu respectarea atât a limitelor legale de adecvare a capitalurilor cât și a celor aprobate intern care sunt mult mai conservatoare.

Riscul de piață al instrumentelor financiare al SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA și al fondurilor administrate este gestionat periodic în cadrul departamentului de risc prin monitorizarea permanentă a pozițiilor financiare ale SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA și fondurile administrate pentru încadrarea permanentă a acestora în categoriile de risc aprobate intern și conform reglementărilor în vigoare.

Evaluarea și administrarea riscurilor de piață, riscurilor de lichiditate sunt cuantificate intern prin monitorizarea periodică. Indicatorii privind adecvarea fondurilor proprii se transmit către Autoritatea de Supraveghere Financiară, sectorul Instrumentelor și Investițiilor Financiare conform legislației în vigoare și normelor interne.

Principiile utilizate de SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA în activitatea de administrare a riscului sunt : separarea activităților pe departamente, asigurarea unor funcții independente de control și administrare a riscurilor, întocmirea și aplicarea unor politici și proceduri interne clare aprobate și implicarea întregului personal în procesul de administrare a riscurilor.

De asemenea, pentru acoperirea riscurilor de răspundere civilă profesională, SAI Swiss Capital Asset Management are încheiate asigurări de răspundere civilă pentru membrii Consiliului de Administrație și conducători.

7. Extras privind concluziile evaluării eficienței sistemului de administrare /management a/al riscurilor în anul 2019

Procedurile interne ale Compartimentului Administrarea Riscului au fost revizuite și actualizate în anul 2019.

A fost efectuat exercițiul de testare la condiții extreme (test de stres) care are scopul de a estima sensibilitatea portofoliilor Fondurilor la șocurile pieței de capital. Factorii de risc de piață, precum ratele dobânzilor, ratele de schimb, prețurile acțiunilor, volatilitatea au fost testate la condiții extreme și a fost analizat impactul asupra fiecărui portofoliu, prin calcularea valorii portofoliului în scenariile simulate și compararea acestuia cu valoarea netă a activelor din data de referință.

Nu s-au înregistrat abateri active de la respectarea limitelor investiționale ale portofoliilor administrate. Cazurile de depășire a limitelor investiționale stabilite prin reglementările legale au fost punctuale și remediate în cel mai scurt timp.

Nu s-au înregistrat evenimente importante de risc operațional și pierderi aferente.

Pe fondul stresului generat în contextul pandemiei COVID -19 în perioada februarie-martie , nu s-au înregistrat evenimente care să conducă la incapacitatea asigurării lichidităților necesare onorării cererilor de rascumpărare.

In semestrul I 2020, s-au avizat si implementat urmatoarele reglementari aplicabile SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA:1) Planul de continuare a activitatii SAI Swiss Capital Asset Management SA in caz de pandemie - de tipul virusului COVID -19 2) Planul de continuare a activitatii SAI Swiss Capital Asset Management SA in caz de pandemie-ACTUALIZAT - de tipul virusului COVID -19

Riscul este inerent in activitatile SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA, dar acesta este gestionat intern printr-un proces continuu de identificare, masurare si monitorizare.

S.A.I SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT S.A.

