

Rapport article 29 de la Loi Energie-Climat

1° Informations relatives à la démarche générale de l'entité (pour toutes les entités financières) :

- a) Résumé de la démarche générale de l'entité sur la prise en compte de critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance, et notamment dans la politique et stratégie d'investissement ;

Pour l'année 2021, Octo Asset Management ne prenait pas en compte les critères ESG dans sa politique et stratégie d'investissement mais a travaillé au développement d'une méthodologie d'analyse et d'intégration des critères extra-financiers qui soit adaptée aux spécificités de l'univers obligataire, un modèle *propriétaire* fondé sur un principe de transparence, construit autour de données essentiellement quantitatives et enrichi par un dialogue constant avec les différents émetteurs qui appartiennent à son univers d'investissement : le modèle **Value 360**.

Cette démarche sera mise en œuvre au cours de l'année 2022.

- b) Contenu, fréquence et moyens utilisés par l'entité pour informer les souscripteurs, affiliés, cotisants, allocataires ou clients sur les critères relatifs aux objectifs environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance pris en compte dans la politique et la stratégie d'investissement ;

Non applicable.

- c) Liste des produits financiers mentionnés au titre des articles 8 et 9 du règlement (UE) 2019/2088 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019, et la part globale, en pourcentage, des encours sous gestion prenant en compte des critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance dans le montant total des encours gérés par l'entité, **le cas échéant** ;

- d) Prise en compte des critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance dans le processus de prise de décision pour l'attribution de nouveaux mandats de gestion par réassureurs et fonds de retraite professionnels **le cas échéant** ;

Non applicable.

- e) Adhésion de l'entité, ou de certains produits financiers, à une charte, un code, une initiative ou obtention d'un label sur la prise en compte de critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance, ainsi qu'une description sommaire de ceux-ci.

Au cours de l'année 2021, Octo AM n'a pas adhéré à une initiative, charte ou code qui concernent la prise en compte de critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance.