31 OCTOBRE 2021

OFI RS Global Convertible Bond

Reporting extra-financier annuel



OFI RS Global Convertible Bond est un FCP de droit français agréé par l'Autorité des Marchés Financiers et géré par OFI Asset Management

A V E R T I S S E M E N T

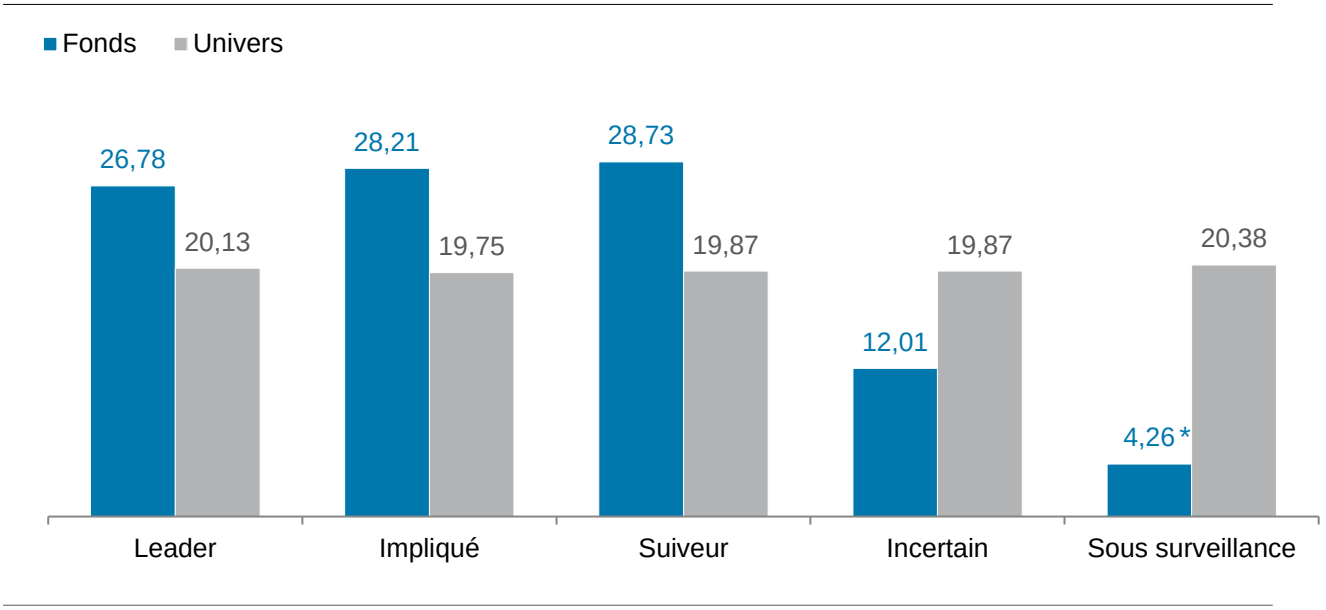
Ce document d'information non contractuel est destiné à des clients professionnels et non professionnels au sens de la Directive MIF. Il ne peut pas être utilisé dans un but autre que celui pour lequel il a été conçu et ne peut pas être reproduit, diffusé ou communiqué à des tiers en tout ou partie sans l'autorisation préalable et écrite d'OFI Asset Management.

Aucune information contenue dans ce document ne saurait être interprétée comme possédant une quelconque valeur contractuelle. Ce document est produit à titre purement indicatif. Il constitue une présentation conçue et réalisée par OFI Asset Management à partir de sources qu'elle estime fiables. OFI Asset Management se réserve la possibilité de modifier les informations présentées dans ce document à tout moment et sans préavis et notamment en ce qui concerne la description des processus de gestion qui ne constitue en aucun cas un engagement de la part d'OFI Asset Management. OFI Asset Management ne saurait être tenu responsable de toute décision prise ou non sur la base d'une information contenue dans ce document, ni de l'utilisation qui pourrait en être faite par un tiers.

Reporting ESG

Évaluation ISR au 31/10/2021

Répartition par catégories ISR en % de l'encours

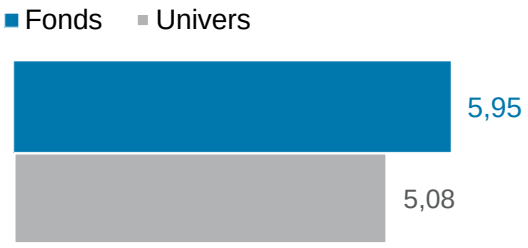


Source : OFI AM

Données disponibles à : 100% de l'encours pour l'univers, 98% pour le fonds calculé hors liquidités

- La catégorie des titres en sous-surveillance seront revus lors de la prochaine notation et vendu sous un mois si la notation en sous-surveillance persiste et que le processus d'engagement n'abouti pas.

Notation du domaine « Environnement »



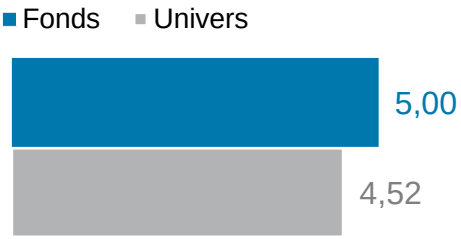
- Notation du domaine « Environnement »
- Note moyenne sur 10
- Reflet de notre analyse de la gestion des enjeux environnementaux par les sociétés du fonds et de l'univers

Source : OFI AM

Données disponibles à : 99% de l'encours pour l'univers, 98% pour le fonds calculé hors liquidités et OPCVM

Reporting ESG
Indicateurs sociaux

Notation du domaine « Social »

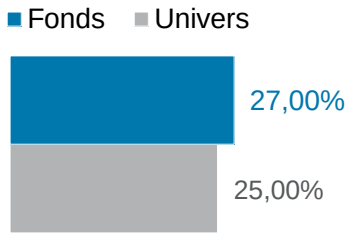


- Note moyenne sur 10
- Reflet de notre analyse de la gestion des enjeux sociétaux par les sociétés du fonds et de l'univers

Source : OFI AM

Données disponibles à : 99% de l'encours pour l'univers, 99% pour le fonds calculé hors liquidités et OPCVM

Indicateur de la part des femmes au sein des Conseils



- Pourcentage moyen de femmes au sein des Conseils d'Administration ou de Surveillance des sociétés

Source : OFI AM

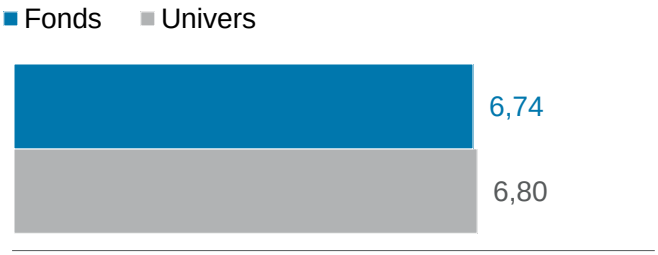
Données disponibles à : 99% de l'encours pour l'univers, 97% pour le fonds calculé hors liquidités et OPCVM

Indicateur de la part des femmes au sein des Conseils

Ce chiffre indique le nombre de femmes siégeant au conseil en pourcentage du total des membres du conseil d'Administration (ou de Surveillance) des sociétés.

Reporting ESG
Indicateurs de gouvernance

Notation du domaine « Gouvernance »

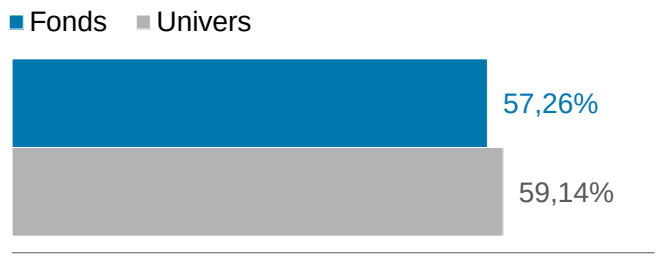


- Note moyenne sur 10
- Reflet de notre analyse de la gestion des enjeux de gouvernance par les sociétés du fonds et de l'univers

Source : OFI AM

Données disponibles à : 99% de l'encours pour l'univers, 99% pour le fonds calculé hors liquidités et OPCVM

Indicateur de la part des membres indépendants au sein des Conseils



- Périmètre : actions détenues en direct
- Pourcentage moyen de membres indépendants au sein des Conseils d'Administration ou de Surveillance des sociétés

Source : OFI AM

Données disponibles à : 99% de l'encours pour l'univers, 97% pour le fonds calculé hors liquidités et OPCVM

Indicateur de la part des membres indépendants

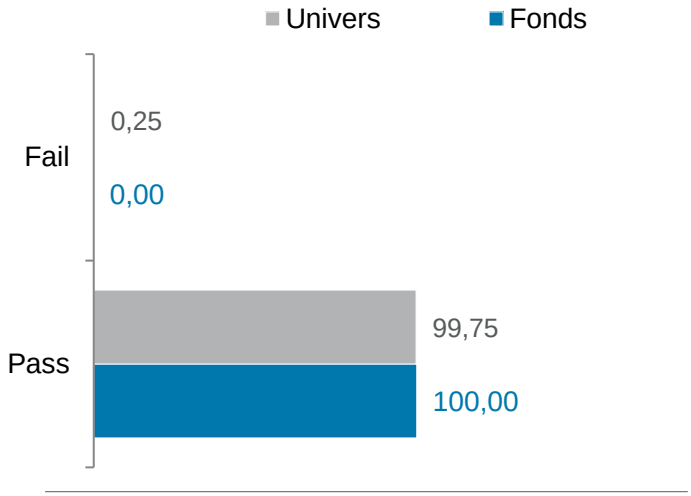
En France, dans le code AFEP-MEDEF, un administrateur est qualifié d'indépendant « lorsqu'il n'entretient aucune relation de quelque nature que ce soit avec la société, son groupe ou sa direction qui puisse compromettre l'exercice de sa liberté de jugement ».

Pour pouvoir être qualifié de « membre libre de conflits d'intérêts », ou bien, « membre indépendant » ou encore « membre libre d'intérêts », le membre du Conseil ne doit pas se trouver dans une situation susceptible d'altérer son indépendance de jugement ou le placer dans une situation de conflit d'intérêt réel ou potentiel. La définition retenue par OFI AM de l'administrateur libre d'intérêt est la suivante :

- Le membre libre de conflits d'intérêts n'est pas un exécutif et n'a pas assumé une fonction exécutive dans la société au cours des cinq dernières années y compris les dirigeants des entités acquises ou de filiales.
- Le membre libre de conflit d'intérêt n'est pas administrateur ou ancien administrateur depuis moins de 3 ans de la société ou des filiales ou percevant une rémunération spécifique significative au titre de services fournis à la société, au groupe, à son actionnaire de référence ou ses dirigeants.
- Le membre libre de conflits d'intérêts n'est pas ou ne représente pas un actionnaire détenant une part substantielle du capital ou des droits de vote égaux ou supérieurs à 3%.
- Le membre libre de conflits d'intérêts n'est pas une personne ayant été actionnaire significatif ou impliquée depuis moins de 3 ans ou impliquée dans une transaction majeure.
- Le membre libre de conflits d'intérêts ne détient aucun mandat croisé, c'est-à-dire un mandat dans une société ayant une participation au capital de la société dont il est aussi membre du Conseil.
- Le membre libre de conflits d'intérêts n'est pas ou n'a pas été commissaire aux comptes de la société au cours des cinq dernières années.
- Le membre libre de conflits d'intérêts n'est pas ou n'a pas été banquier, avocat, consultant, client, fournisseur de la société au cours des cinq dernières années.
- Le membre libre de conflits d'intérêts n'a pas de contrat de travail dans une des entités du groupe.
- Le membre libre de conflits d'intérêts n'a pas de lien familial avec un mandataire social ou un actionnaire de référence.
- Le membre libre de conflits d'intérêts n'appartient pas à un groupe ou une société administrée par un des dirigeants de la société.
- Un membre libre de conflits d'intérêts perd cette qualification lorsqu'il est dans sa douzième année – ou plus - de mandat en tant que membre du conseil.
- Le membre libre de conflits d'intérêts n'est pas salarié, ancien salarié depuis moins de 5 ans, mandataire social ou membre du conseil d'une société bancaire ou financière.
- Le membre libre de conflits d'intérêts ne détient pas de mandat politique afin de ne pas avoir de conflit entre l'intérêt général et l'intérêt privé.

Reporting ESG
Indicateurs de respect des Droits Humains

% de conformité aux principes du Pacte Mondial



- La conformité des pratiques des sociétés aux principes du Pacte Mondial des Nations Unies (ou Global Compact) est classée en deux catégories :
  - « Pass » : sociétés respectant les principes du Pacte Mondial
  - « Fail » : sociétés ne respectant pas ces principes

Source : OFI AM

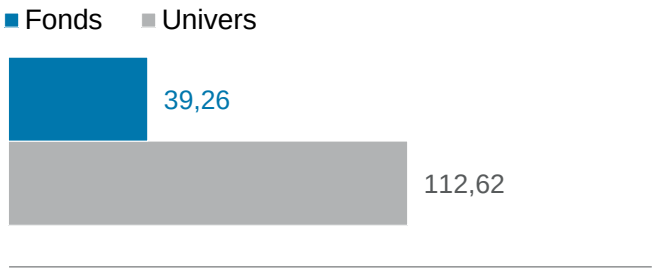
Données disponibles à : 100% de l'encours pour l'univers, 98% pour le fonds calculé hors liquidités et OPCVM

Conformité aux Principes du Pacte mondial des Nations Unies

Sont considérés comme étant en non-conformité avec les 10 Principes du Pacte Mondial de l'ONU, les émetteurs qui font face à une ou des controverses de sévérité élevée ou très élevée sur des sujets liés à au moins l'un des 10 principes du Pacte mondial et qui ne mettent pas en place des mesures de remédiation ou des réponses appropriées ou adaptées. La fréquence de telles controverses est également prise en compte dans l'analyse de conformité.

Reporting TEE – Poche actions et taux
Empreinte carbone

- **Émissions financées** (teqCO_2/m€)



- Mode de calcul

$$\frac{\text{Encours détenu} \times \text{Total des émissions carbone de la société}}{\text{Total du passif de la société}}$$

Source : OFI AM

Données disponibles à : 87% de l'encours pour l'univers, 95% pour le fonds calculé hors liquidités et OPCVM

Les émissions Carbone ou émissions de GES (Gaz à Effet de Serre), exprimées en tonnes équivalent CO2, sont des données qui proviennent soit des entreprises – directement ou via des déclarations faites au Carbon Disclosure Project, soit des données estimées par un prestataire (MSCI).

Ces émissions comportent trois catégories *(Source : ADEME)* :

- Émissions directes de GES (ou SCOPE 1) : Émissions directes provenant des installations fixes ou mobiles situées à l'intérieur du périmètre organisationnel, c'est-à-dire émissions provenant des sources détenues ou contrôlées par l'organisme comme par exemple : combustion des sources fixes et mobiles, procédés industriels hors combustion, émissions des ruminants, biogaz des centres d'enfouissements techniques, fuites de fluides frigorigènes, fertilisation azotée, biomasses…
- Émissions à énergie indirectes (ou SCOPE 2) : Émissions indirectes associées à la production d'électricité, de chaleur ou de vapeur importée pour les activités de l'organisation.
- Autres émissions indirectes (ou SCOPE 3) : Les autres émissions indirectement produites par les activités de l'organisation qui ne sont pas comptabilisées au 2 mais qui sont liées à la chaîne de valeur complète comme par exemple : l'achat de matières premières, de services ou autres produits, déplacements des salariés, transport amont et aval des marchandises, gestions des déchets générés par les activités de l'organisme, utilisation et fin de vie des produits et services vendus, immobilisation des biens et équipements de production…

Même s'il serait souhaitable d'utiliser les trois Scopes pour calculer les intensités, le niveau de normalisation du Scope 3 est actuellement insuffisant pour permettre une utilisation pertinente dans la comparaison entre plusieurs entreprises.