

COMMUNIQUÉ DE PRESSE

L'ERAFP attribue vingt-et-un mandats de gestion ISR d'actions cotées sur les zones euro, Europe et Japon.

Paris, le 23 novembre 2023 – Dans le cadre du renouvellement de ses mandats, l'Établissement de Retraite additionnelle de la Fonction publique (ERAFP) vient d'attribuer vingt-et-un mandats de gestion de portefeuilles - onze actifs et dix dits stand-by - d'actions cotées sur les zones euro, Europe et Japon.

La consultation, lancée en septembre 2022, portait sur six lots correspondant respectivement à six types d'approche (deux lots de gestion indicielle et quatre lots de gestion fondamentale). À l'issue de cette procédure formalisée, l'Établissement a décidé de retenir les offres des sociétés suivantes :

Lot 1 – Gestion d'actions de la zone Euro selon une approche indicielle visant à répliquer l'indice ERAFP SRI Index on MSCI EMU

- Titulaire d'un mandat actif : **Amundi Asset Management**
- Titulaire d'un mandat *stand-by* : **DWS Investment SA**

Lot 2 - Gestion d'actions de la zone Euro selon une approche indicielle visant à répliquer l'indice SciBeta Eurozone SRI carbon efficient MSR CTB index

- Titulaire d'un mandat actif : **BlackRock France S.A.S**
- Titulaire d'un mandat *stand-by* : **BNP Paribas Asset Management France**

Lot 3 - Gestion fondamentale ISR d'actions cotées de moyennes et grandes capitalisations de la zone Euro

- Titulaires de mandats actifs : **Allianz Global Investors GmbH, BNP Paribas Asset Management France, Lazard Frères Gestion SAS, Tocqueville Finance SA et Edmond de Rothschild Asset Management France**
- Titulaires de mandats *stand-by* : **Mirova et DNCA Finance**

Lot 4 - Gestion fondamentale ISR d'actions de moyennes et grandes capitalisations, Europe

- Titulaire d'un mandat actif : **Candriam**
- Titulaires de mandats *stand-by* : **Comgest et BlackRock France S.A.S**

Lot 5 - Gestion fondamentale ISR d'actions de petites capitalisations de la zone Europe

- Titulaire d'un mandat actif : **BFT Investment Managers** qui délèguera la gestion financière à **Montanaro Asset Management Limited**
- Titulaires de mandats *stand-by* : **FIL Gestion et Amiral Gestion**

Lot 6 - Gestion fondamentale ISR d'actions toutes capitalisations, Japon

- Titulaires d'un mandat actif : **Comgest** et **BFT Investment Managers** qui délèguera la gestion financière à **Wellington Management Japan**
- Titulaires de mandats *stand-by* : **Pictet Asset Management SA** et **Lazard Frères Gestion SAS**

Que ce soit dans le cadre du lot 1 ou du lot 2, les titulaires auront pour objectif de développer une gestion indicielle par réplication en titres vifs des indices de référence respectifs. La conformité du portefeuille avec le Dispositif ISR de l'ERAFP sera assurée à travers le processus de construction de l'indice de référence.

Dans le cadre des autres lots, les titulaires développeront une gestion non benchmarkée basée sur l'analyse fondamentale des titres de l'univers d'investissement. L'objectif de gestion sera d'obtenir une performance supérieure à celle de l'indice de comparaison de la performance dans le respect du Dispositif ISR de l'ERAFP.

Enfin, il sera attendu que chaque titulaire vote activement aux assemblées générales des entreprises détenues en portefeuille, en cohérence avec la politique de vote de l'ERAFP.

Avec le renouvellement de ces mandats, l'ERAFP poursuit la montée en charge du Régime et renforce ainsi sa contribution au financement de l'économie.

À titre indicatif :

Le montant global alloué sur la durée du marché pour chacun des lots de gestion indicielle sera compris entre un et dix milliards d'euros, et sera compris entre cinq cents millions et huit milliards d'euros pour chacun des lots de gestion fondamentale.

La durée du marché sera de six ans avec la possibilité pour l'ERAFP de le reconduire pour deux périodes successives d'un an chacune. Dix des vingt-et-un mandats attribués étant dits *stand-by*, l'ERAFP se réserve l'opportunité de les activer, ou non, sur toute cette période.

L'ERAFP : 1er fonds de pension public français et investisseur institutionnel 100 % ISR

Avec près de 40 milliards d'actifs financiers investis dans leur intégralité suivant une démarche 100 % socialement responsable, l'ERAFP se place parmi les plus grands investisseurs institutionnels ISR. Dès la création du Régime en 2005, le conseil d'administration a fait le choix d'optimiser la performance de son portefeuille d'actifs financiers dans le respect des principes ISR. Signataire des Principes d'investissement responsable de l'ONU, l'ERAFP a adopté, en mars 2006, une Charte ISR, reposant sur les cinq valeurs suivantes : État de droit et droits de l'Homme ; Progrès social ; Démocratie sociale ; Environnement ; Bonne gouvernance et transparence.

L'ERAFP est également l'un des plus importants fonds de pension publics au monde en termes d'affiliés avec près de 4,5 millions de bénéficiaires, 44000 employeurs et 2 milliards d'euros de cotisations collectées en 2022. Régime de retraite obligatoire, par points, l'Établissement gère, depuis le 1er janvier 2005, les droits à une retraite additionnelle pour les fonctionnaires de l'État, des collectivités territoriales et du secteur public hospitalier.

Pour plus d'informations sur l'ERAFP → www.rafp.fr

CONTACT PRESSE Alice Blais – T 01 58 50 96 36 – alice.blais@erafp.fr

   rafp.fr