

COMMUNIQUÉ DE PRESSE

L'ERAFP lance un appel d'offres pour sélectionner des gérants d'Actions cotées de la zone euro et européennes.

Paris, le 26 mai 2016 – Dans le cadre du renouvellement de mandats arrivant à échéance en mai 2017, l'Établissement de Retraite additionnelle de la Fonction publique (ERAFP) lance un appel d'offres ouvert pour sélectionner des gestionnaires d'actions cotées de la zone euro et européennes.

A fin avril 2016, le portefeuille d'actions cotées de la zone euro de l'ERAFP dont les mandats arrivent à échéance avait une valeur d'environ 5 milliards d'euros.

Afin de sélectionner les sociétés de gestion auxquelles seront attribués les nouveaux mandats, l'ERAFP lance un appel d'offres qui comprend cinq lots :

Lot 1 – Mandat de gestion indicielle ISR d'actions de moyennes et grandes capitalisations de la zone euro

Le lot 1 aura pour objet la gestion **indicielle** d'un portefeuille composé d'actions de moyennes et grandes capitalisations zone euro. L'indice retenu est le « Scientific Beta Eurozone Max Sharpe Ratio ERAFP SRI Carbon Efficient index » calculé par ERI Scientific Beta, construit spécifiquement pour les besoins de l'ERAFP et dont l'objectif est d'optimiser le couple rendement-risque d'un univers d'actions de la zone euro, pays développés. Cet indice, de type smart beta, intègre notamment le dispositif ISR de l'ERAFP et une méthodologie de décarbonation.

A titre indicatif les montants confiés au démarrage pour ce lot seront compris entre 500 millions et 1 milliard d'euros. Trois gérants seront retenus à l'issue de la procédure, dont deux dits « stand-by ».

Lot 2 – Mandat de gestion fondamentale ISR non benchmarkée d'actions cotées de moyennes et grandes capitalisations de la zone euro.

Le lot 2 aura pour objet la **gestion fondamentale ISR non benchmarkée** d'un portefeuille composé d'actions de moyennes et grandes capitalisations cotées de la **zone euro**.

A titre indicatif les montants confiés au démarrage pour ce lot seront compris entre 250 millions et 1 milliard d'euros. Cinq gérants seront retenus à l'issue de la procédure, dont deux dits « stand-by ».

Lot 3 – Mandat de gestion fondamentale ISR non benchmarkée d'actions cotées de moyennes et grandes capitalisations de la zone euro avec gestion du risque actions.

Le lot 3 aura pour objet la **gestion fondamentale ISR non benchmarkée** d'un portefeuille composé d'actions de moyennes et grandes capitalisations cotées de la **zone euro**, avec **gestion du risque actions**. La gestion du risque actions se fera à l'aide d'instruments financiers à terme. L'entreprise d'investissement cherchera à maximiser la performance du portefeuille tout en limitant la perte sur une année grâce à une gestion en budget de risque mesuré par la perte maximale sur une année calendaire.

A titre indicatif les montants confiés au démarrage pour ce lot seront compris entre 250 millions et 1 milliard d'euros. Trois gérants seront retenus à l'issue de la procédure, dont deux dits « stand-by ».

Lot 4 – Mandat de gestion fondamentale ISR non benchmarkée d’actions cotées de petites capitalisations Europe

Le lot 4 aura pour objet la **gestion fondamentale ISR non benchmarkée** d’un portefeuille composé d’actions cotées de **petites capitalisations européennes**.

A titre indicatif les montants confiés au démarrage pour ce lot seront de l’ordre de 140 millions d’euros. Trois gérants seront retenus à l’issue de la procédure, dont deux dits « stand-by ».

Lot 5 – Mandat de gestion fondamentale ISR non benchmarkée d’actions cotées de moyennes et grandes capitalisations Europe

Le lot 5 aura pour objet la gestion **fondamentale ISR non benchmarkée** d’un portefeuille composé d’actions cotées de **moyennes et grandes capitalisations européennes**.

A titre indicatif les montants confiés au démarrage pour ce lot seront compris entre 250 millions et 1 milliard d’euros. Trois gérants seront retenus à l’issue de la procédure, dont deux dits « stand-by ».

Pour ces cinq lots, la composition du portefeuille devra être conforme au **dispositif ISR de l’ERAFP**. Pour cela les entreprises d’investissements devront analyser chaque action de leur portefeuille au regard du dispositif ISR de l’ERAFP par leurs propres moyens et/ou en s’appuyant sur des ressources externes.

Les mandats seront d’une durée de **six ans**.

Le dossier de consultation est disponible *via* le site Internet de l’ERAFP, www.rafp.fr ou sur www.achatpublic.com.

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

Avec plus de 24 milliards d’euros d’actifs financiers investis dans leur intégralité suivant une démarche 100 % socialement responsable, l’ERAFP se place au premier rang européen des 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, 45000 employeurs et près de 1,77 milliard d’euros de cotisations collectées en 2013. 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 E alice.blais@erafp.fr