

France-Paris: Portfolio management services

OJ S 115/2023 16/06/2023

Contract notice**Services****Legal Basis:**

Directive 2014/24/EU

Section I: Contracting authority

I.1. Name and addresses

Official name: fonds de réserve pour les retraites

Town: Paris

NUTS code: FR France

Country: France

Contact person: ld-frr-dcj@caissedesdepots.fr

E-mail: ld-frr-dcj@caissedesdepots.fr**Internet address(es):**Main address: <https://www.fondsdereserve.fr/fr>**I.3. Communication**The procurement documents are available for unrestricted and full direct access, free of charge, at: <https://www.achatpublic.com/sdm/ent2/gen/accueil.action?tp=1686150355363>

Additional information can be obtained from the abovementioned address

Tenders or requests to participate must be submitted electronically via: <https://www.achatpublic.com/sdm/ent2/gen/accueil.action?tp=1686150355363>**I.4. Type of the contracting authority**

Body governed by public law

I.5. Main activity

Economic and financial affairs

Section II: Object

II.1. Scope of the procurement**II.1.1. Title**

marche 2023frr04 - mandats de gestion active responsable : Actions américaines

Reference number: 2023FRR04

II.1.2. Main CPV code

66140000 Portfolio management services

II.1.3. Type of contract

Services

II.1.4. Short description

le Marché a pour objet la gestion active responsable par des prestataires de services d'investissement pour la gestion des mandats des deux lots décrits ci-après. Le FRR entend par " gestion active ", la mise en oeuvre de décisions d'investissement induisant des positions

individuelles différentes de celles de l'indice de référence, dans les conditions qui seront définies dans les mandats de gestion, dans le but d'atteindre un surcroît significatif de performance.

le FRR entend par " gestion active responsable ", la prise en compte par les candidats sélectionnés dans leurs processus de gestion et/ou d'analyse, d'enjeux ESG, tout en intégrant la politique d'exclusions (armes prohibées, tabac, et charbon) et d'engagement du FRR ainsi que l'objectif de décarbonation détaillé ci-après.

II.1.5. Estimated total value

II.1.6. Information about lots

This contract is divided into lots: yes

Tenders may be submitted for all lots

II.2. Description

II.2.1. Title

actions des Etats-Unis, gestion active responsable de grandes et moyennes capitalisations (" Blend ") "

Lot No: 1

II.2.2. Additional CPV code(s)

66140000 Portfolio management services

II.2.3. Place of performance

NUTS code: FR France

II.2.4. Description of the procurement

le lot 1 porte sur la gestion active responsable sans biais de style systématique (" Blend ") de, au maximum, trois (3) mandats de gestion qui devront mettre en oeuvre une exposition aux actions américaines de grandes et moyennes capitalisations. L'Indice de référence retenu pour mesurer la performance des gestionnaires aura des caractéristiques similaires à un indice représentatif du marché actions des grandes et moyennes capitalisations pondéré des capitalisations ou un indice climatique type CTB sans biais de style. Il sera précisé dans les mandats de gestion lors de la phase d'offres. L'Approche de gestion pourra être fondamentale ou quantitative active. Le FRR, compte tenu de son passif, recherche des processus qui offrent une liquidité importante. L'Objectif de gestion assigné aux titulaires des mandats de gestion sera de surperformer l'indice de référence sur la durée des mandats. L'Écart de suivi (ou Tracking Error) ex-ante maximal est fixé à 10% per annum. Cette gestion active s'effectuera sans limites de déviation sectorielle. La devise de référence du portefeuille est l'us Dollar

II.2.5. Award criteria

Price is not the only award criterion and all criteria are stated only in the procurement documents

II.2.6. Estimated value

II.2.7. Duration of the contract, framework agreement or dynamic purchasing system

Duration in months: 60

This contract is subject to renewal: yes

Description of renewals:

un mandat pourra, à l'initiative du FRR, être reconduit pour une période d'un an. Le FRR prendra par écrit la décision de reconduire ou non un mandat. Le titulaire du mandat ne pourra refuser sa reconduction. Celle-ci ne donnera lieu à aucune modification du présent Marché

II.2.9. Information about the limits on the number of candidates to be invited

Envisaged minimum number: 5Maximum number: 10

II.2.10. Information about variants

Variants will be accepted: no

II.2.11. Information about options

Options: no

II.2.13. Information about European Union funds

The procurement is related to a project and/or programme financed by European Union funds:
no

II.2.14. Additional information

II.2. Description

II.2.1. Title

" Actions des Etats-Unis, gestion active responsable de petites capitalisations "
Lot No: 2

II.2.2. Additional CPV code(s)

66140000 Portfolio management services

II.2.3. Place of performance

NUTS code: FR France

II.2.4. Description of the procurement

le lot 2 porte sur la gestion active responsable de, au maximum, deux mandats de gestion qui devront mettre en oeuvre une exposition aux actions américaines de petites capitalisations. L'Indice de référence retenu pour mesurer la performance des gestionnaires aura des caractéristiques similaires à un indice représentatif du marché actions des petites capitalisations pondéré des capitalisations. Il sera précisé dans les mandats de gestion lors de la phase d'offres. La capitalisation minimale des sociétés dans lesquelles les gestionnaires pourraient investir en est limitée à deux cents (200) millions d'euros au moment de l'achat. La capitalisation maximale hors indice est limitée à dix (10) milliards d'euros au moment de l'achat. L'Approche de gestion pourra être fondamentale ou quantitative active. Le FRR, compte tenu de son passif, recherche des processus qui offrent une liquidité importante. L'Objectif de gestion assigné aux titulaires des mandats de gestion sera de surperformer l'indice de référence sur la durée des mandats. Le budget de risque ex ante (" tracking error ") maximal sera de 10 % p.a. Cette gestion active s'effectuera sans limites de déviation sectorielle La devise de référence du portefeuille est l'us Dollar

II.2.5. Award criteria

Price is not the only award criterion and all criteria are stated only in the procurement documents

II.2.6. Estimated value

II.2.7. Duration of the contract, framework agreement or dynamic purchasing system

Duration in months: 60

This contract is subject to renewal: yes

Description of renewals:

un mandat pourra, à l'initiative du FRR, être reconduit pour une période d'un an. Le FRR prendra par écrit la décision de reconduire ou non un mandat. Le titulaire du mandat ne pourra refuser sa reconduction. Celle-ci ne donnera lieu à aucune modification du présent Marché

II.2.9. Information about the limits on the number of candidates to be invited

Envisaged minimum number: 5Maximum number: 10

II.2.10. Information about variants

Variants will be accepted: no

II.2.11. Information about options

Options: no

II.2.13. Information about European Union funds

The procurement is related to a project and/or programme financed by European Union funds:
no

II.2.14. Additional information

Section IV: Procedure

IV.1. Description

IV.1.1. Type of procedure

Restricted procedure

IV.1.3. Information about a framework agreement or a dynamic purchasing system

The procurement involves the establishment of a framework agreement
Framework agreement with several operatorsEnvisaged maximum number of participants to the framework agreement: 5

IV.1.8. Information about the Government Procurement Agreement (GPA)

The procurement is covered by the Government Procurement Agreement: yes

IV.2. Administrative information

IV.2.2. Time limit for receipt of tenders or requests to participate

Date: 08/08/2023 Local time: 12:00

IV.2.3. Estimated date of dispatch of invitations to tender or to participate to selected candidates

IV.2.4. Languages in which tenders or requests to participate may be submitted

French

Section VI: Complementary information

VI.1. Information about recurrence

This is a recurrent procurement: yes

VI.3. Additional information

VI.4. Procedures for review

VI.4.1. Review body

Official name: tribunal administratif de Paris

Town: Paris

Country: France

VI.5. Date of dispatch of this notice

13/06/2023