



Communiqué de presse

Paris, le 18 novembre 2020

Les universités de Cambridge et d'Oxford s'associent à Amundi pour développer une stratégie d'investissement sans énergie fossile et à faible émission de carbone

Amundi, le premier gestionnaire d'actifs Européen¹, ainsi que Clare College, Cambridge et Corpus Christi College, Oxford ont annoncé leur collaboration en vue d'élaborer une stratégie indiciaire ESG sur mesure dans le cadre de leur transition vers l'investissement à faible émission carbone.

Clare College va faire basculer toute l'allocation actions de son fonds de dotation vers cette nouvelle stratégie. Cela traduit leur volonté d'atteindre l'objectif zéro carbone et de réduire le risque de dévaluation de leurs actifs bloqués² sur le long terme.

Cette stratégie sur mesure a été développée par Amundi, en collaboration avec les intendants de plusieurs collèges de l'Université de Cambridge et de l'Université d'Oxford. Elle repose sur une réplique d'indice efficiente, conçue pour offrir un profil d'investissement plus responsable et prendre en compte le risque financier lié au changement climatique.

Plus précisément, la stratégie ambitionne de répliquer la performance du MSCI ACWI tout en intégrant plusieurs objectifs centrés sur l'ESG :

1. Éliminer du portefeuille tous les actifs liés aux combustibles fossiles, actions du secteur de l'énergie et les centrales à charbon
2. Rechercher une amélioration considérable des revenus dits « verts » et réduire l'intensité en carbone³
3. Réduire le risque d'exposition aux controverses⁴

Afin de s'assurer que cette stratégie n'entraîne pas une déviation trop importante par rapport à l'indice et donc des biais non désirés, l'exposition au facteur « value » fait également l'objet d'un suivi très rigoureux.

Comme dans toutes les stratégies indiciaires déployées par Amundi, la solution s'appuiera sur les capacités du groupe à engager le dialogue avec les entreprises dont il est actionnaire, afin de discuter

¹ Source : Rapport « Top 500 Asset Managers » d'IPE publié en juin 2020, sur la base des encours sous gestion au 31/12/2019

² Actifs bloqués (Stranded assets): Actifs figurant aux bilans des entreprises et qui perdent rapidement de leur valeur à la suite de dépréciations forcées.

³ La stratégie améliorera de 50 % les revenus verts et réduira de 30 % l'intensité carbone

⁴ En plus d'exclure les réserves de combustible fossile, le secteur de l'énergie et les centrales à charbon, la stratégie élimine les entreprises impliquées dans des controverses importantes (violations du Pacte mondial de l'ONU) ou dans la fabrication ou la distribution d'armes controversées, de même que les entreprises qui dérivent plus de 0 % de leur chiffre d'affaires ou de leur production d'énergie du charbon, du tabac ou du divertissement pour adultes.

des aspects ESG. L'accent sur le dialogue et le droit de vote favorisent un changement positif et durable dans l'intérêt des entreprises, de leurs investisseurs et de l'ensemble de la société.

Amundi et les équipes d'investissement des universités d'Oxford et de Cambridge travailleront conjointement pour faire évoluer la stratégie dans le temps, en fonction des changements permanents dans le domaine de l'investissement responsable. Cette approche dynamique permettra d'assurer que la stratégie reste bien positionnée pour rechercher les meilleurs rendements ajustés du risque.

Amundi bénéficie d'une longue expérience en matière de conception et de gestion de stratégies indicielles climatiques et ESG personnalisées, destinées aux investisseurs internationaux. En particulier, le groupe a récemment lancé les premières stratégies indicielles alignées sur l'objectif 2 °C de l'Accord de Paris.

Paul Warren, Intendant de Clare College, Cambridge, a déclaré : « Clare College a l'ambition d'obtenir les meilleurs rendements possibles pour son fonds de dotation, afin de continuer à soutenir sa population étudiante. L'évolution de notre allocation actions vers cette solution jouera un rôle essentiel pour atteindre cet objectif, tout en réduisant notre exposition au risque climatique. Nous avons soigneusement sélectionné Amundi en raison de sa flexibilité, de son expérience en gestion de solutions climatiques, et de son expertise dans le domaine de la gestion indicielle. »

Ashley Fagan, Responsable ETF, Indexing & Smart Beta pour le UK et l'Irlande chez Amundi, a indiqué : « Nous avons le plaisir de travailler avec les collèges des universités d'Oxford et de Cambridge pour le lancement et la gestion d'une nouvelle solution indicelle ESG sur mesure, qui répond aux besoins des fonds de dotation. La stratégie que nous avons élaborée conjointement offre aux fonds de dotation, aux organisations caritatives et aux investisseurs professionnels une approche simple et efficace pour réduire l'exposition de leur portefeuille au risque climatique sur un horizon à long terme. »

A propos d'Amundi

Premier gérant d'actifs européen parmi les 10 premiers acteurs mondiaux⁵, Amundi propose à ses 100 millions de clients - particuliers, institutionnels et entreprises - une gamme complète de solutions d'épargne et d'investissement en gestion active et passive, en actifs traditionnels ou réels.

Ses six plateformes de gestion internationales⁶, sa capacité de recherche financière et extra-financière, ainsi que son engagement de longue date dans l'investissement responsable en font un acteur de référence dans le paysage de la gestion d'actifs.

Les clients d'Amundi bénéficient de l'expertise et des conseils de 4 500 professionnels dans près de 40 pays. Filiale du groupe Crédit Agricole, Amundi est cotée en Bourse et gère aujourd'hui plus de 1 650 milliards d'euros d'encours⁷.

Amundi, un partenaire de confiance qui agit chaque jour dans l'intérêt de ses clients et de la société.

www.amundi.com   

About Clare College

Clare College was founded in 1326 and was the first of the Oxford and Cambridge foundations to provide for a Master, Fellows and Scholars in a single community. It remains today a society of academics and students brought together by a common interest in learning, teaching and research. The College has 95 Fellows, 300 graduate students and approximately 460 students following undergraduate or professional courses. Clare's Endowment – currently around £125 million – is designed to ensure the College's Financial sustainability and independence, now and for the future.

About Corpus Christi College

Corpus Christi College was founded in 1517 by Bishop Richard Fox of Winchester. Uniquely in Oxford at that time, it was founded as a centre for humanist learning and benefits from an historic trilingual library much admired by

⁵ Source : IPE « Top 500 Asset Managers » publié en juin 2020 sur la base des encours sous gestion au 31/12/2019

⁶ Boston, Dublin, Londres, Milan, Paris et Tokyo

⁷ Données Amundi au 30/09/2020

Erasmus. It is the smallest of the medieval Oxford foundations. It is supported by its endowment which is invested in a broad selection of assets including property as well as public and private equity.

Contact Presse

Geetha Chandrasegaram

Tel : +33 1 76 37 02 73

geetha.chandrasegaram@amundi.com

DISCLAIMER

« Le présent document est destiné exclusivement aux journalistes et professionnels de la presse et des médias. Les informations concernant la stratégie indiciaire ESG sont fournies dans le seul but de permettre aux journalistes et professionnels de la presse et des médias d'avoir une vue d'ensemble de la stratégie et ce quel que soit l'usage qu'ils en font, qui relève exclusivement de l'indépendance éditoriale et pour lequel Amundi décline toute responsabilité. Il appartient à toute personne intéressée par cette stratégie, préalablement à toute souscription, de prendre connaissance des documents réglementaires des supports intégrant cette stratégie.

Ce document n'est pas destiné à l'usage des résidents ou citoyens des Etats Unis d'Amérique et des « U.S. Persons », telle que cette expression est définie par la « Regulation S » de la Securities and Exchange Commission en vertu du U.S. Securities Act de 1933. La définition de « US Person » vous est fournie dans les mentions légales du site, www.amundi.com.

Information promotionnelle non contractuelle ne constituant ni un conseil en investissement, ni une recommandation, ni une sollicitation d'achat ou de vente.