

FON.TE.

**QUESTIONARIO
PER LA SELEZIONE DEL DEPOSITARIO DEL
FONDO**

Il presente questionario costituisce parte integrante della richiesta pubblica di offerta per il servizio di depositario pubblicata, per estratto, su "Sole 24 Ore" e "Corriere della Sera" in data 20/12/2018.

Il questionario, compilato in ogni sua parte esclusivamente in lingua italiana, dovrà essere inviato nei termini e con le modalità indicate dal bando.

Istruzioni per la compilazione

Il candidato (in seguito indicato come *Offerente*) deve compilare tutte le sezioni che compongono il questionario seguendo tassativamente la sequenza delle domande proposte e utilizzando la metodologia e il formato specificati nelle presenti istruzioni.

I volumi devono riferirsi al 31 dicembre di ogni anno considerato, se non diversamente indicato.

Gli importi devono essere espressi in migliaia di Euro. Diverse indicazioni dei dati, che comportino qualsiasi ambiguità di interpretazione, determineranno l'esclusione della domanda specificata dalla valutazione del questionario.

Nella compilazione del questionario è possibile avvalersi di documenti allegati da rendere disponibili in formato elettronico insieme alla versione MS-Word dello stesso su supporto digitale non riscrivibile.

Inoltre si chiede di allegare alla documentazione una bozza di SLA (Service Level Agreement) e di contratto.

Assetto Proprietario

Descrivere l'assetto proprietario del Gruppo di appartenenza, nonché la catena di controlli e di partecipazioni che legano la capogruppo alla Società candidata e alle altre Società eventualmente coinvolte nell'attività oggetto della presente candidatura. La risposta deve isolare le informazioni richieste evitando di rappresentare l'intera struttura di partecipazioni.

Nel caso in cui la Società candidata non faccia capo ad alcun Gruppo occorre riportare l'assetto proprietario della Società candidata.

Stabilità assetto proprietario

Indicare se sono in corso o sono state annunciate revisioni dell'assetto del Gruppo con particolare riferimento all'area cui fa capo la Società candidata.

In caso di risposta affermativa, fornire una indicazione circa l'impatto di tali cambiamenti sull'area cui fa capo la Società candidata.

Indicare inoltre se sono in corso processi di revisione dell'assetto societario.

Patrimonio netto Offerente e del Gruppo di appartenenza

Indicare il patrimonio netto della Offerente riferito agli anni indicati. Riportare in nota eventuali informazioni aggiuntive integrative sui fatti rilevanti che influiscono sui valori riportati (fusioni, acquisizioni, scorpori etc.).

(€ mln)	2013	2014	2015	2016	2017
Patrimonio netto Società candidata					
Patrimonio netto Gruppo					

Note:

Rating della Società Offerente

Indicare il rating della Società *Offerente*.

Indicare la Società di rating ed il rating per gli anni richiesti:

Rating assegnato alla Società Offerente	2015	2016	2017
Standard & Poor's			
Moody's			
Fitch			

(se e solo se non esiste rating della società *offerente*, indicare il rating della capogruppo)

Caratteristiche della Società Offerente ed esperienza maturata

Fornire indicazioni sulla organizzazione aziendale relativa al servizio richiesto, specificando l'ubicazione della sede operativa.

Con riferimento alle attività di custodia, amministrazione titoli, regolamento e controllo, descrivere l'esperienza maturata nei confronti della clientela istituzionale e dei fondi pensione, riferita per quest'ultima tipologia anche all'attività di trasferimento da altra banca depositaria.

Descrivere la struttura organizzativa, specificando per il personale direttivo dedicato direttamente alle attività di custodia, regolamento e controllo e relazione, il ruolo e gli anni di esperienza totali e maturati in azienda.

Indicare le risorse umane coinvolte direttamente alle attività sopraindicate e le funzioni svolte secondo la seguente tabella:

Funzione	Numero Risorse

Indicare se all'interno della Offerente esiste un team dedicato in via esclusiva ai Fondi pensione, elencando le risorse dedicate in via esclusiva ai Fondi pensione secondo la seguente tabella:

Nome	Incarico ricoperto	Anni di esperienza	Anzianità nella Società

Indicare le masse complessive dei patrimoni in custodia (in mln di Euro) per clientela istituzionale negli ultimi 5 anni, come specificato nella tabella seguente:

Anno	2013	2014	2015	2016	2017
Totale masse patrimoni in custodia per clientela istituzionale italiana	€	€	€	€	€
Numero clienti istituzionali italiani totali- inizio anno					
Numero clienti istituzionali italiani acquisiti – durante l’anno					
Numero clienti istituzionali italiani persi – durante l’anno					
Numero clienti istituzionali italiani totali- fine anno					
Masse medie gestite per cliente a fine anno					

Specificare la tipologia di clientela italiana per numero di clienti e masse gestite secondo le seguenti tabelle:

Totale masse clienti Istituzionali italiani in milioni di Euro e numero di clienti	2013		2014		2015		2016		2017	
	€	N.								
Fondi Pensione negoziali										
Casse di previdenza - Fondazioni										
Fondi Pensione preesistenti										
Fondi pensione aperti										
Totale										

Parte B – Operatività, controllo e reportistica

1. Descrivere le modalità tecniche (sistemi informatici, applicativi web) ed operative per garantire il collegamento tra il Depositario, Fondo ed i propri gestori delegati.
2. Indicare i gestori con i quali avete in condivisione procedure operative e interfacce automatiche in Italia.
3. Descrivere le modalità e le procedure del servizio di regolamento delle operazioni poste in atto dai gestori delegati.
4. Indicare le modalità di calcolo e di verifica delle commissioni di gestione da riconoscere periodicamente ai gestori delegati.
5. Indicare in caso di sottoscrizione di OICR/FIA le modalità di asseveramento della loro adeguatezza rispetto alla politica d'investimento.
6. Indicare le modalità di verifica della restituzione delle commissioni di gestione sugli OICR eventualmente presenti nei portafogli del fondo pensione.
7. Illustrare la procedura di verifica della correttezza del calcolo del NAV, in tutte le sue componenti. Indicare la tempistica prevista per il controllo (t+1, t+2 ecc....).
8. Illustrare le modalità tecniche ed operative con cui saranno effettuati i controlli nel rispetto delle politiche di investimento sui singoli comparti, delle linee di indirizzo della gestione e dei limiti di investimento di cui alle disposizioni normative e alle convenzioni di gestione tempo per tempo vigenti. Precisare tipologia, modalità e tempi dei controlli eseguiti dal Depositario.
9. Indicare la procedura di gestione degli errori nel valore quota emersi dopo l'asseveramento del Depositario.
10. Indicare il numero di sub-custodi appartenenti al Depositario e le principali garanzie con le quali viene assicurata la protezione del patrimonio del Fondo.
11. Specificare come il Depositario svolge le funzioni di comunicazione verso il Fondo riguardo gli aggiornamenti di carattere normativo e fiscale concernenti la previdenza in Italia ed all'estero.
12. Indicare, in caso di affidamento dell'incarico, il tipo di supporto fornito per la migrazione/set-up del patrimonio del Fondo; definire inoltre, le modalità e la tempistica nell'adeguamento dei flussi operativi e contabili attualmente in essere.
13. Specificare le attività poste in essere nell'ambito del Disaster Recovery Plan.
14. Indicare se il Depositario è in grado di offrire un servizio di misurazione delle performance e del rischio; specificare se tale servizio possa includere la valutazione del patrimonio del Fondo secondo i principi ESG (precisando la cadenza dei report che possono essere resi disponibili).

15. Caricamento dati tramite FTP dalla banca depositaria a Bloomberg.
16. Specificare, se prevista, la possibilità di effettuare pagamenti con la firma elettronica.

Parte C - Servizi a valore aggiunto

1. Dettagliare le tipologie di servizio offerte in relazione ad operazioni di copertura del rischio di cambio.
2. Indicare se il Depositario è in grado di fornire un sistema di *clearing* globale dei derivati quotati, integrato con il proprio servizio, e dettagliarne il funzionamento.
3. Indicare se il Depositario è in grado di fornire un servizio Tax Reclaim (specificare modello operativo, presenza di ufficio interno dedicato all'attività, capacità di rendicontazione periodica dello stato di avanzamento dei rimborsi, presenza di formato di supporto "chiavi-in-mano" al cliente, con pre-compilazione dei moduli di richiesta e rapporto con l'Agenzia delle Entrate da parte del Depositario).
4. Specificare se il Depositario è in grado di offrire un servizio di gestione dei derivati OTC in conformità con il regolamento e gli obblighi EMIR. Dettagliare se si è in grado di fornire una reportistica di controllo, anche con riferimento agli strumenti quotati.
5. Specificare se si è in grado di offrire un servizio di marginalizzazione sui contratti FX Forward, con annessa reportistica a favore del Fondo.
6. Indicare se si calcola il soft NAV.
7. Indicare se si fornisce il servizio di controllo degli oneri finanziari.
8. Indicare se la società fornisce il servizio di calcolo del *turnover* (specificare canale tecnico di fornitura, riferimento metodica a Circolare Covip 17-feb-2012, presenza di calcolo *rolling*).
9. Indicare se la società è in grado di offrire ai clienti istituzionali un supporto di compliance in materia di lorp2 e investimento in strumenti alternativi (private assets).