



**PREVIDENZA COOPERATIVA – Fondo Pensione Nazionale a  
capitalizzazione dei lavoratori, soci e dipendenti, delle imprese cooperative e  
per i lavoratori dipendenti addetti ai lavori di sistemazione idraulico-forestale  
ed idraulico-agraria**

**PUBBLICA SOLLECITAZIONE DI OFFERTE PER LA SELEZIONE DI  
SOGGETTI A CUI AFFIDARE L'INCARICO DI CUI ALL'ART. 7, D. LGS.  
N. 252/2005 (in breve: il Bando)**

**QUESTIONARIO**

---

*Consiglio di Amministrazione del 20/04/2020*  
Il Bando è pubblicato per estratto sui quotidiani:  
Milano Finanza e Italia Oggi  
il 05/05/2020

Il presente Questionario costituisce parte integrante e sostanziale della richiesta pubblica di offerta per il servizio di Depositaria pubblicata, per estratto, su Milano Finanza e Italia Oggi il 04/05/2020.

### **Istruzioni per la compilazione**

L'Istituto candidato (in seguito indicato anche come *banca* o *Società offerente* o *Società candidata* o *Depositario*) deve compilare tutte le sezioni del Questionario seguendo tassativamente la sequenza delle domande proposte e utilizzando la metodologia e il formato specificati nelle presenti istruzioni, nonché nelle singole domande.

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

Gli importi devono essere espressi in milioni di euro e devono essere riportati con la notazione decimale italiana. Diverse indicazioni dei dati che comportino qualsiasi ambiguità di interpretazione determineranno l'esclusione della domanda specificata dalla valutazione del questionario.

Si chiede di allegare alla documentazione una bozza di SLA (Service Level Agreement) e di convenzione.

Per i quesiti che prevedono la compilazione di campi di testo liberi:

- 1) la lunghezza dei campi di testo è limitata ad un numero di caratteri ritenuto congruo. Tali dimensioni sono da intendersi massime.
- 2) Taluni quesiti prevedono la presentazione di allegati. Tali allegati dovranno essere inviati su unico file .pdf indicando il numero del quesito di riferimento. Il file .pdf dovrà essere denominato nella seguente forma: "NOME CANDIDATO\_Allegati al questionario".
- 3) Eventuali informazioni che si ritenesse necessario fornire in aggiunta a quanto richiesto dovranno essere incluse nel medesimo file .pdf al precedente punto *sub* 2).

Per i quesiti che prevedo la selezione dei campi predefiniti:

- Talune domande prevedono risposte predefinite all'interno di un elenco a tendina. In tal caso è obbligatorio utilizzare le risposte riportate nell'elenco.

Per i quesiti che prevedo la compilazione di campi numerici:

- le unità di misura sono indicate nei quesiti stessi. Ad esempio, se il quesito richiede un dato espresso in MLN € inserire solo un numero nella apposita cella, senza unità di misura. Inoltre, tutti i dati numerici dovranno essere riportati secondo notazione italiana (utilizzando il punto (".") come separatore di migliaia e la virgola (",") come separatore dei decimali.

## Parte A – Informazioni sulla Società ed esperienza maturata

Compilare con i seguenti dati relativi alla Società offerente e alla persona di riferimento per il presente questionario:

Ragione sociale	
Sede	
Indirizzo	
Città	
Cap	
Paese	
Persona di riferimento	
Ruolo	
Recapito telefonico	
Recapito fax	
Indirizzo posta elettronica	

Indicare se la Società offerente ha sede statutaria in Italia o in altro Paese dell'Unione Europea.

Nel caso di Società offerente con sede statutaria in altro Paese indicare:

Sede legale (Paese)	
Succursale in Italia (indirizzo)	
Authority di controllo	

## Informazioni inerenti eventuali altri soggetti coinvolti nel mandato

Indicare l'eventuale affidamento a Società terze (anche appartenenti al gruppo) di particolari funzioni collegate all'esercizio del mandato. Specificare la natura del mandato conferito dalla Società offerente a tale Società delegata, nonché la configurazione contrattuale dello stesso riportando tutte le informazioni necessarie per consentire la valutazione delle possibili ricadute operative e contrattuali.

Compilare una scheda per ognuna delle eventuali Società coinvolte.

Società	
Sede legale	
Appartenente al gruppo (SI/NO)	
Oggetto della delega e natura del mandato conferito	

## Gruppo di appartenenza

Fornire una breve descrizione della compagine societaria dell'Offerente e dell'eventuale Gruppo di appartenenza. Nel caso in cui si abbia una strutturazione societaria complessa (ad

es. un gruppo finanziario o assicurativo che faccia capo a sua volta ad altro gruppo) riferirsi al Gruppo a cui fa direttamente capo la Società candidata.

È possibile dare evidenza della struttura più generale di appartenenza. Tali riferimenti, che devono essere ben identificabili e aggiuntivi rispetto al contenuto di base, devono essere riportati esclusivamente nel caso in cui si ritenga essi abbiano rilevanza e impatto ai fini dello svolgimento del servizio oggetto della presente selezione.

Fornire le seguenti indicazioni circa il gruppo di appartenenza:

Ragione sociale	
Indirizzo	
Stato sede legale	
Natura del Gruppo (bancario, assicurativo, o specificare)	

### 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.

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 Società candidata e del Gruppo di appartenenza

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

(in mln €)	2015	2016	2017	2018	2019
Patrimonio netto Società candidata					
Patrimonio netto Gruppo di appartenenza					

Note	
------	--

### Rating della Società offerente

Indicare il rating della Società candidata

Per quanto riguarda il rating indicare la Società di rating ed il rating per gli anni richiesti:

Rating assegnato a Società offerente	2017	2018	2019
Standard & Poor's			
Moody's			
Fitch			

Nel caso in cui la Società candidata non disponga di un proprio rating indicare se disponibile quello eventualmente riferito alla Società controllante. In questo caso specificare la Società a cui tale rating si riferisce.

### 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 dei fondi pensione italiani, riferita anche all'attività di trasferimento da altro depositario.

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 Società offerente esiste un team dedicato in via esclusiva ai Fondi pensione, indicando 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 €) per fondi pensione italiani e clientela istituzionale italiana negli ultimi 5 anni, come specificato nella tabella seguente:

Anno	2015	2016	2017	2018	2019
<b>Totale masse in custodia per fondi pensione italiani</b>					
<b>Numero fondi pensione italiani clienti</b>					
<b>Totale masse in custodia per clienti istituzionali italiani</b>					
<b>Numero clienti istituzionali italiani</b>					

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

Totali masse clienti Istituzionali italiani in mln di € e numero clienti	2015	2016	2017	2018	2019
	€ n.	€ n.	€ n.	€ n.	€ n.
Fondi Pensione Negoziati					
Fondi Pensione Aperti – PIP					
Fondi Pensione Preesistenti					
Casse di Previdenza – Fondazioni					

## Parte B – Operatività, controllo e reportistica

1. Illustrare i sistemi informatici e le modalità tecnico-operative con le quali saranno effettuati i controlli del rispetto 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.

2. Illustrare i sistemi informatici e le procedure con cui saranno effettuati i controlli per la verifica di conformità delle istruzioni ricevute dai gestori alle disposizioni di legge, allo statuto del Fondo Pensione, alle convenzioni da quest'ultimo stipulate con i gestori finanziari e alle prescrizioni degli organi di vigilanza. Precisare tipologia, modalità e tempi dei controlli eseguiti dal depositario.
3. Allegare esempi della reportistica destinata al Fondo Pensione, con rappresentazione dei controlli di cui ai precedenti punti *sub* 1) e 2) e dell'esito degli stessi, precisando la periodicità di invio di tale reportistica. In particolare, dettagliare l'operatività prevista per la comunicazione delle eventuali violazioni riscontrate dal depositario rispetto ai controlli di cui ai precedenti punti *sub* 1) e 2).
4. Illustrare la procedura di verifica della correttezza del calcolo del NAV e la reportistica sull'esito del controllo, con evidenza della tempistica prevista (t+...); allegare un esempio di comunicazione indirizzata al Fondo Pensione riportante l'esito del controllo.
5. Descrivere le modalità tecniche (sistemi informatici, applicativi web) e le procedure operative esistenti per:
  - effettuare il servizio di regolamento delle operazioni in valori mobiliari/divise poste in atto dai gestori delegati, con particolare attenzione alle procedure operative attivate per evitare i mancati regolamenti;
  - verificare i prezzi dei titoli e degli strumenti negoziati, evidenziando possibili interventi manuali e descrivere l'esecuzione della verifica sulla congruità dei prezzi su titoli esteri, titoli non quotati e contratti derivati;
  - verificare le commissioni di gestione da riconoscere periodicamente ai gestori delegati;
  - in caso di sottoscrizione di OICR/ETF/FIA indicare le procedure di asseveramento della loro compatibilità con la politica di investimento del Fondo e di verifica della restituzione delle commissioni di gestione;
  - verificare che le condizioni e i costi di negoziazione siano corrispondenti alle regole vigenti nei rispettivi mercati e alle specifiche previste nelle convenzioni di gestione;
  - verificare e rappresentare al fondo pensione le attività presenti nel portafoglio degli OICR in cui risulti eventualmente investita parte del patrimonio del fondo stesso (look through) ed i controlli effettuati sugli stessi OICR;
  - verificare e controllare l'attività negli strumenti derivati quotati ed OTC in coerenza con quanto indicato dal Regolamento EMIR e dalle convenzioni di gestione. Dettagliare se si è in grado di fornire una reportistica di controllo.
6. Descrivere le procedure operative da porre in essere tra Depositario, gestori finanziari, service amministrativo e Fondo pensione. Indicare gli eventuali gestori finanziari del Fondo pensione con i quali il Candidato non ha in condivisione procedure operative e interfacce automatiche in Italia.
7. Specificare le attività poste in essere nell'ambito del Disaster recovery plan.

8. Presentare brevemente la tipologia di servizi offerti per ridurre alla fonte le tasse sui proventi esteri e per il recupero di tasse pagate in eccesso all'estero e per recuperare le imposte sui dividendi.
9. Indicare se la Società offerente già opera con il service amministrativo del Fondo: Previnet S.p.A..
10. Presentare sinteticamente il piano operativo per la connessione in ambito hardware e software con i gestori finanziari e il service amministrativo.
11. Strumenti informatici che la banca metterà a disposizione del fondo pensione e dei gestori per l'esecuzione delle operazioni, per il controllo dell'operatività sui portafogli, per la consultazione degli strumenti detenuti negli stessi e della relativa movimentazione.
12. Indicare se il Depositario è in grado di fornire e con quale modalità (in via diretta o meno) un sistema di clearing dei derivati quotati integrato con il proprio servizio, dettagliandone il funzionamento. Indicare i costi di tale servizio, sia se fornito direttamente sia nel caso non sia fornito in via diretta.
13. Descrivere gli eventuali servizi a valore aggiunto offerti al Fondo (quali ad esempio il servizio di misurazione delle performance e del rischio; specificare se tale servizio possa includere la valutazione del patrimonio del fondo secondo principi ESG), con evidenza di ogni caratteristica utile per poter valutare i servizi offerti. Con riferimento alle Disposizioni Covip del 16 marzo 2012 descrivere poi i flussi informativi forniti al Fondo per consentire l'alimentazione dei sistemi di controllo della gestione finanziaria (e.g. StatPro, Bloomberg, ecc.).
14. Con riferimento al calcolo del Nav e ad altri servizi di interesse per il fondo pensione si invita a fornire ogni indicazione ritenuta utile.
15. Fornire una lista aggiornata delle sub depositarie, indicando il numero di quelle appartenenti al Depositario e le garanzie con le quali viene assicurata la protezione del patrimonio del Fondo.
16. Descrivere, in caso di affidamento dell'incarico, la tipologia di supporto fornita per la migrazione del patrimonio del Fondo e il conseguente set-up, indicando anche la possibile tempistica, a partire dallo stop-dealing che il Fondo dovrà dare ai gestori finanziari. Con specifico riferimento ai fondi pensione italiani, indicare il numero di migrazioni gestite



negli ultimi 5 anni, le tempistiche medie di migrazione e l'ammontare dei patrimoni oggetto di migrazione.

17. Specificare la possibilità di effettuare pagamenti con firma elettronica.