

**Si prega di considerare con estrema attenzione le istruzioni di seguito riportate in quanto contenenti elementi che possono influenzare l'attribuzione di punteggio utile ai fini della definizione della graduatorie di merito.**

#### Sezioni del Questionario

**Il questionario si compone delle seguenti sezioni:**

[1. Informazioni generali](#)

[2. Proposta di gestione per CNPR](#)

[3. Approccio ESG](#)

[4. Team di gestione, risk management e reporting](#)

[5. Track record](#)

La Cassa si impegna a tenere il più rigoroso riserbo in ordine a qualsiasi dato, notizia o informazione fornita nel Questionario e l'utilizzo - anche per il consulente di cui la Cassa si avvale - sarà strettamente connesso alle finalità della presente selezione. La Cassa è disponibile inoltre a concordare con il Candidato eventuali accordi di riservatezza ove si ritengano necessari.

#### Definizioni e istruzioni per la compilazione

Quesiti che prevedono la compilazione di campi di testo liberi:

- la lunghezza dei campi di testo è generalmente limitata ad un numero di caratteri ritenuto congruo. Tali dimensioni sono da intendersi come massime.
- Taluni quesiti prevedono la presentazione di allegati. Tali allegati dovranno necessariamente essere inviati su unico file pdf indicando il numero del quesito di riferimento. Il file pdf dovrà essere denominato nella seguente forma : "Nome del candidato\_Allegati al questionario".
- Eventuali informazioni che si ritenesse necessario fornire in aggiunta a quanto richiesto dovranno essere incluse nel medesimo file pdf suddetto. Al riguardo si prega di utilizzare la massima sinteticità e di contenere a casi specifici, oggettivamente rilevanti e motivabili (es. impossibilità di esporre i dati secondo la metodologia richiesta e relative motivazioni) le informazioni aggiuntive.

Quesiti che prevedono la selezione di campi predefiniti:

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

Quesiti che prevedono la compilazione di campi numerici:

- in via generale 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 la notazione italiana (utilizzando il punto (".") per separare le migliaia, la virgola (",") per separare i decimali).

**Ai fini del presente questionario possono essere presentati esclusivamente portafogli valutati e rendicontati secondo valori e criteri di mercato.**

Per quanto riguarda i dati relativi al patrimonio/numero di portafogli gestiti, essi devono intendersi riferiti al 31 dicembre di ogni anno considerato, salvo diversa indicazione.

Gli importi dei patrimoni devono essere espressi in milioni di Euro applicando il cambio ufficiale BCE rilevato nell'ultimo giorno lavorativo disponibile di ciascun anno.

Ai fini del questionario, fatte salve le istruzioni specifiche contenute nelle singole domande, si considerano "Clienti/Investitori Istituzionali" i seguenti tipi di clienti:

1. Clienti/Investitori istituzionali Italiani: Fondi pensione italiani, Casse di previdenza, Fondi/casse sanitarie, Fondazioni, Enti Pubblici, Gestioni separate del ramo Vita, Banche, Assicurazioni; si escludono invece OICR e SICAV.
2. Clienti/Investitori Istituzionali Esteri: oltre alle tipologie estere corrispondenti a quelle previste per "Clienti/Investitori Istituzionali Italiani" vanno inclusi gli Organismi Sovranazionali; si escludono invece OICR e SICAV.

Gli OICR/SICAV non si considerano pertanto facenti parte della clientela istituzionale; la richiesta di informazioni sugli stessi, ove prevista, è effettuata espressamente.

**Qualora richiesti, per "OICR/SICAV" ai fini del questionario vanno intesi ed esclusivamente indicati quelli rientranti nell'ambito di applicazione della direttiva 2009/65/UE e ss. (cd. "Ucits").**

Infine, si considerano "clienti captive" ai fini del questionario: gli enti/società facenti parte del medesimo gruppo di appartenenza del Candidato.

Laddove richiesto, i rendimenti nominali dovranno essere calcolati secondo la metodologia GIPS, in Euro, applicando il cambio ufficiale BCE, ed espressi in percentuale, fino alla seconda cifra decimale.

Per l'indicazione del Turnover di portafoglio si richiede - ove possibile - di utilizzare le modalità richieste da Covip (cfr. circolare 17 febbraio 2012 prot. 648).

Sez.	Num.	Domanda	Risposta	caratt. res.
1	1	Ragione sociale del Candidato.		
1	2	Con riferimento alla data di pubblicazione del Bando, indicare in Tabella le informazioni societarie richieste.	<a href="#">Tabella 2</a>	
1	3	<p>Descrivere brevemente:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- struttura e ripartizione per aree di business del Gruppo di appartenenza indicando, in particolare, il peso dell'attività di asset management rispetto al totale delle attività svolte;</li> <li>- la compagine azionaria del Candidato e i relativi rapporti di controllo rispetto al Gruppo di appartenenza;</li> <li>- l'organigramma del Candidato (è possibile presentare allegato .pdf);</li> <li>- l'eventuale divisione dedicata alla clientela istituzionale presso la candidata. (massimo 2000 caratteri)</li> </ul>		2000
1	4	<p>Indicare (includendo contatto telefonico e indirizzo mail):</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Referenti per la selezione (al massimo 2 nominativi);</li> <li>- Relationship Manager di lingua italiana incaricato in caso di affidamento. (Allegare CV in pdf, max 1 pg).</li> </ul>		
1	5	<p>Indicare in Tabella il patrimonio e il numero di portafogli gestiti a dic. 2018, dic. 2019 e dic. 2020 per:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- mandati segregati per clientela istituzionale, esclusivamente non captive;</li> <li>- OICR/Sicav Uclis.</li> </ul> <p>Per gli stessi dettagliare la quota % gestita adottando approcci ESG.</p>	<a href="#">Tabella 5</a>	
1	6	<p>Fornire indicazioni sulle modalità di prevenzione dei conflitti di interesse nella compravendita dei titoli indicando le modalità di separazione dei portafogli gestiti, nonché le procedure di controllo interno esistenti, con particolare riferimento ai rapporti fra soggetti emittenti del Gruppo e gestori del Gruppo nonché ai rapporti fra il team di gestione e gli altri team del Gruppo.</p> <p>Indicare, infine, se è stato adottato un codice etico che sanzioni comportamenti in contrasto con gli interessi della clientela (massimo 1000 caratteri)</p>		1000
1	7	<p>Indicare:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- gli eventi societari accaduti negli ultimi 3 anni, ovvero già prevedibili alla data di compilazione del questionario, che hanno avuto/potranno avere riflessi sulla organizzazione dell'asset management e/o sulla gestione di mandati similari;</li> <li>- se presente, l'ultimo rating assegnato per l'attività di gestione di portafoglio (es. Fitch AMR asset management) al Candidato, specificandone l'anno di riferimento. (massimo 1000 caratteri)</li> </ul>		1000

Sez.	Num.	Domanda	Risposta	caratt. res.
2	8	<p>Illustrare sinteticamente la strategia di investimento per il mandato evidenziando in particolare:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- il processo di costruzione del portafoglio e la selezione titoli;</li> <li>- in quale modo la valutazione del rischio ed il budget ad esso associato, incidono nelle decisioni di investimento;</li> <li>- le modalità e la frequenza di revisione della view macro e dell'outlook di medio periodo;</li> <li>- quali comitati si riuniscono periodicamente, numero e ruolo dei partecipanti, presenza del responsabile della gestione del mandato e relativa incidenza nelle scelte;</li> <li>- la tipologia di ricerca economico-finanziaria di cui ci si avvale, precisando quanta/quale parte della ricerca è svolta internamente, nr. di analisti interni (in FTE) e società da questi monitorate per mandati simili.</li> </ul> <p>(massimo 3000 caratteri)</p>		3000
2	9	<p>Indicare in Tabella il grado di importanza, nelle scelte gestionali attive, dei principali driver di performance riportati.</p>	<a href="#">Tabella 9</a>	
2	10	<p>Presentare in Tabella una proposta di allocazione iniziale del portafoglio nell'attuale contesto di mercato, tenendo conto dei limiti d'investimento contenuti nel Bando. Descrivere, inoltre, le assunzioni su cui è stata costruita la proposta.</p> <p>(massimo 2000 caratteri)</p>	<a href="#">Tabella 10</a>	2000

Sez.	Num.	Domanda	Risposta	caratt. res.
2	11	Descrivere i vostri processi e strumenti a supporto della valutazione dell'affidabilità degli emittenti obbligazionari, in particolare specificando eventuali elementi di analisi ulteriori rispetto ai rating assegnati dalle agenzie specializzate (es. Moody's, S&P, Fitch) e il nr. di emittenti (distinguendo tra governativi, corporate IG e HY) sottoposti a tale screening proprietario. (massimo 1000 caratteri)		1000
2	12	Specificare se si intende utilizzare OICR/ETF. In caso positivo chiarire motivazioni, costi a carico del portafoglio, processo di selezione degli strumenti, modalità di fornitura dei look through per verificare l'allocazione dei fondi target; denominazione e AuM degli OICR/ETF eventualmente individuati per il mandato. (massimo 1000 caratteri)		1000
2	13	Fornire in Tabella stima dei livelli commissionali medi (in %) che verranno applicati sulle transazioni azionarie, per area geografica e il turnover azionario medio annuo atteso per il mandato in oggetto. Indicare inoltre una stima annua in Euro degli oneri di transazione azionari gravanti sul mandato, utilizzando come base per tale stima il patrimonio oggetto di affidamento iniziale (200 Mln €).	<a href="#">Tabella 13</a>	
2	14	Descrivere le responsabilità ed i ruoli del team di gestione nell'implementazione delle strategie evidenziando in particolare: - le modalità volte a perseguire la best execution; - le responsabilità nell'execution; - le modalità di interfaccia con i trader e con i broker e le policy relative ad eventuali controparti del gruppo di appartenenza. (massimo 1000 caratteri)		1000
3	15	Indicare se nelle scelte di investimento della proposta di gestione sono considerati approcci ESG. In caso affermativo descriverne le modalità di implementazione, in particolare specificando: - obiettivi ESG e/o impatti perseguiti; - eventuale utilizzo di criteri negativi di esclusione (es. Convenzioni internazionali, armi, carbone etc); - criteri positivi di selezione (es. Best in Class, Tematici, Integrazione di variabili ESG; impact investing); - metodologia di monitoraggio e misurazione periodica di obiettivi/impatti e reporting a favore dei propri clienti; - modalità di ricerca (interna o esterna); numerosità, ruolo e organizzazione del team coinvolto. Specificare se le scelte di investimento della proposta di gestione, classificano il mandato come conforme ex art. 8 o 9 del Reg. 2019/2088 e se vengono presi in considerazione i principali effetti negativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità (PAI come definiti dal Reg. 2019/2088) (massimo 2000 caratteri)		2000

Sez.	Num.	Domanda	Risposta	caratt. res.
3	16	<p>Descrivere:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- la politica di engagement, in particolare facendo riferimento a quanti casi all'anno vengono gestiti e alla modalità con la quale vengono identificati</li> <li>- le modalità di comunicazione e reporting delle scelte di investimento ESG effettuate, delle decisioni di voto e dei risultati dell'engagement agli stakeholder (investitori, consulenti, fornitori di ricerca ESG, staff interno).</li> </ul> <p>Fornire nel caso alcuni esempi (massimo 2000 caratteri)</p>		2000
3	17	<p>Indicare in Tabella:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- eventuale adesioni a charter internazionali in materia di sostenibilità, principi, codici di condotta, iniziative nazionali o internazionali specificando l'anno di adesione;</li> <li>- eventuali rating ESG di agenzie specializzate utilizzate nelle valutazioni di investimento/scoring degli emittenti in portafoglio.</li> </ul>	<a href="#">Tabella 17</a>	
4	18	<p>Indicare in Tabella:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- le informazioni sintetiche richieste sul responsabile della gestione del mandato (è possibile allegare CV dettagliato in pdf);</li> <li>- l'esperienza delle risorse (fino a un massimo di 5, incluso il Responsabile della gestione), con almeno due anni di esperienza lavorativa, dedicate alla gestione del mandato.</li> </ul>	<a href="#">Tabella 18</a>	

Sez.	Num.	Domanda	Risposta	caratt. res.
4	19	<p>Indicare sinteticamente:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- struttura, funzionamento, dislocazione del team di gestione dedicato al mandato;</li> <li>- stabilità e continuità degli attuali componenti;</li> <li>- eventuali variazioni negli ultimi 3 anni o già prevedibili alla data di compilazione del questionario.</li> </ul> <p>(massimo 2000 caratteri, allegare in pdf <u>solamente l'organigramma in forma grafica</u>)</p>		2000
4	20	<p>Indicare in Tabella le informazioni sintetiche richieste sul responsabile della funzione Risk Management. È possibile allegare CV dettagliato in formato .pdf.</p>	<p><a href="#">Tabella 20</a></p>	
4	21	<p>Indicare quali sono i parametri monitorati dal Risk Manager per questo tipo di mandato e come vengono determinati eventuali limiti operativi, quale reportistica standard viene rilasciata alla Cassa e con quale periodicità.</p> <p>Indicare, inoltre, disponibilità ad adeguare i contenuti della reportistica sulla base di specifiche richieste in fase di set-up che di successiva gestione del mandato.</p> <p>(massimo 2000 caratteri)</p>		2000
4	22	<p>Indicare:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- esperienza di collaborazione (attuali o pregresse) con la banca depositaria di CNPR (Bnp Paribas);</li> <li>- la disponibilità a collaborare per lo svolgimento del prestito titoli.</li> </ul> <p>(massimo 1000 caratteri)</p>		1000

Sez.	Num.	Domanda	Risposta	caratt. res.
5	23	<p>Compilare le Tabelle, includendo portafogli "Bilanciati globali" conformi", ordinati per patrimonio decrescente.            È possibile includere esclusivamente:            - mandati segregati gestiti per clientela istituzionale Europea non captive (sino a un massimo di 7);            - OICR/Sicav UCITS (sino ad un massimo di 3).            La mancata indicazione del nome del Cliente per i mandati segregati comporterà una penalizzazione.</p> <p>* I portafogli conformi rendicontati devono rispettare TUTTI i criteri di conformità (sia per il portafoglio sia per il benchmark) di seguito elencati pena esclusione.</p> <p><b>Criteri di conformità del portafoglio:</b>            - valorizzazione e rendicontazione a valori di mercato;            - presenza di parametro di riferimento (<u>ovvero benchmark</u>) interamente espresso da indici di mercato (non sono ammesse le cd. "gestioni total return")            - patrimonio non inferiore a: 50 Mln € per mandati segregati; 200 Mln € per OICR/Sicav;            - gestione in corso al 31/12/2020;            - stile di gestione attivo.</p> <p><b>Criteri di conformità del benchmark:</b>            - diversificazione a livello globale;            - quota azionaria compresa tra il 20% e il 50%;            - obbligazioni high yield ed emergenti non superiori al 20%;            - quota azioni Paesi Emergenti non superiore al 10%.</p>	<p style="text-align: center;"><a href="#">Tabella 23a - Mandati segregati</a></p> <hr/> <p style="text-align: center;"><a href="#">Tabella 23b - OICR/Sicav Ucits</a></p>	

**1. Informazioni generali**

2. Informazioni societarie	Riferirsi alla data di pubblicazione del Bando
Sede statutaria del Candidato	
Gruppo di appartenenza del Candidato	
Sede di eventuale succursale italiana (o altra stabile organizzazione) in Italia	
Autorizzazione a svolgere l'attività prevista dal Bando	
Società esterna responsabile dell'audit	
Capitale sociale - Candidato (Min €)	
Mezzi di terzi in gestione ovvero le attività a copertura delle riserve tecniche dei Rami Vita - Gruppo di appartenenza (Min €)	

**5. Asset Under Management**

Composizione per PATRIMONIO (Min €)	dic. 20	dic. 19	dic. 18
Mandati segregati per investitori istituzionali non captive*, di cui:	0	0	0
FONDI PENSIONE NEGOZIALI ITALIANI			
FONDI PENSIONE PREESENTI ITALIANI			
CASSE DI PREVIDENZA ITALIANE (EX D.LGS. 509/94 e/o D.LGS. 103/96)			
ALTRI CLIENTI ISTITUZIONALI ITALIANI			
ALTRI CLIENTI ISTITUZIONALI ESTERI			

OICR/SICAV Ucits			
<b>TOTALE PATRIMONIO</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>

<b>- di cui gestito tramite approccio ESG (% su TOTALE PATRIMONIO)</b>	<b>0,0%</b>	<b>0,0%</b>	<b>0,0%</b>
Mandati segregati per investitori istituzionali non captive*			
OICR/SICAV Ucits			

Composizione per NUMERO PORTAFOGLI (Min €)	dic. 20	dic. 19	dic. 18
Mandati segregati per investitori istituzionali non captive*, di cui:	0	0	0
FONDI PENSIONE NEGOZIALI ITALIANI			
FONDI PENSIONE PREESENTI ITALIANI			
CASSE DI PREVIDENZA ITALIANE (EX D.LGS. 509/94 e/o D.LGS. 103/96)			
ALTRI CLIENTI ISTITUZIONALI ITALIANI			
ALTRI CLIENTI ISTITUZIONALI ESTERI			

OICR/SICAV Ucits			
<b>TOTALE NUMERO PORTAFOGLI</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>

<b>- di cui gestito tramite approccio ESG (% su TOTALE NUMERO PORTAFOGLI)</b>	<b>0,0%</b>	<b>0,0%</b>	<b>0,0%</b>
Mandati segregati per investitori istituzionali non captive*			
OICR/SICAV Ucits			

\*Escludere patrimoni gestiti per enti/società del Gruppo di appartenenza

**2. Proposta per CNPR**

9. Principali driver di performance	Peso indicativo (totale = 100%)
Allocazione dinamica tra le asset class	
<b>Obbligazionari</b>	
Allocazione geografica (curva Euro vs ex-Euro)	
Duration	
Credito (es. periferici vs centrali, curva Euro vs corporate)	
Emissioni reali vs nominali	
Liquidità emissioni	
Selezione titoli	
<b>Azionari</b>	
Allocazione geografica	
Allocazione settoriale	
Allocazione dimensionale "Large/mid vs small cap"	
Allocazione per potenziale di crescita "Value" vs "Growth"	
Selezione titoli	
<b>Altro</b>	
Per la compilazione della voce "Altro", specificare sovrascrivendo la cella	
<b>Totale</b>	<b>0,0%</b>



10. Proposta di portafoglio iniziale per asset class (totale=100%)	peso % BMK (indicativo)	peso % proposta iniziale PTF	Duration (anni, bond)	modalità di implementazione prevalente
Liquidità	-			
Governativo Emu	7,5%			
Governativo Europa ex Emu	0,4%			
Governativo Nord America	2,2%			
Governativo Pacifico	1,4%			
Governativo Inflation Linked Emu	14,0%			
Governativo Emergenti	7,5%			
Corporate Euro IG	10,0%			
Corporate Europa ex Euro IG	1,0%			
Corporate USD IG	6,5%			
Altro Obb. Corporate IG (incl. nel bmk)	2,5%			
Corporate Euro HY	1,4%			
Corporate Europa ex Euro HY	0,2%			
Corporate USD HY	5,4%			
Altro Obb. Corporate HY (incl. nel bmk)	0,0%			
Azionario Emu	8,4%		-	
Azionario Europa ex Emu	7,6%		-	
Azionario Nord America	14,7%		-	
Azionario Pacifico	2,3%		-	
Azionario Emergenti	7,0%		-	
Altro (specificare)	-			
<b>OBBLIGATORIO:</b> in caso di compilazione della voce "Altro", specificare le asset class incluse e il relativo peso %. Indicare inoltre per ognuna di queste asset class motivazione dell'inclusione e modalità di implementazione prevalente				
<b>TOTALE</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00%</b>		
	<b>BMK</b>	<b>PTF</b>		
Rendimento atteso a 5 anni (medio annuo totale)				
Volatilità attesa a 5 anni (media annua totale)				
Excess return		0,0%		
TEV attesa				
Duration (anni)				
Rendimento a scadenza - local currency (bond)				
Rendimento a scadenza - euro hedged (bond)*				
Rating (bond)				
Esposizione su strumenti obbligazionari subordinati (su tot. ptf.)				
Esposizione su strumenti obbligazionari ibridi (su tot. ptf.)				
Esposizione su strumenti obbligazionari cartolarizzati (su tot. ptf.)				
Esposizione su strumenti obbligazionari HY (su tot. ptf.)				
Price Earnings (azioni)				
Dividend Yield (azioni)				
Esposizione valuta lorda (coperture cambio) non euro (su tot. ptf.)				
Esposizione valuta netta (coperture cambio) non euro (su tot. ptf.)				
Peso indicativo OICR in portafoglio				
Esposizione indicativa derivati in portafoglio				
Numero indicativo titoli per la gestione del mandato				
Bid - ask medio della proposta (bps)				
Turnover annuo atteso				
Specificare se si intende utilizzare derivati per il mandato, chiarendo tipologia di strumenti, finalità operative e stile di gestione, modalità di assolvimento degli obblighi della normativa EMIR (reg. UE 648/2012) in nome e per conto di CNPR. (max 1000 caratteri)				caratteri residui  1000

\* ossia inclusiva dei costi di copertura del cambio vs. euro

13. Oneri di transazione azionaria	Livelli commissionali medi sul trading (%)
Area Euro	
Europa ex Euro	
Nord America	
Pacifico	
Emergenti	
Turnover azionario atteso annuo (%)	
Oneri annui stimati derivanti dalle transazioni azionarie per il mandato (€)	
Specificare se nella stima degli oneri sopra riportata per il mandato sono addebitati costi di ricerca. In caso affermativo, specificarne tipologia e incidenza sulla stima in € fornita per il mandato. (massimo 500 caratteri)	500

*caratteri residui*
**3. Approccio ESG**

17. Adesione a principi/codici ESG e scoring	Adesione	Anno di adesione
<b>Charter Internazionali</b>		
United Nations Principles for Responsible Investment		
United Nations Global Compact		
United Nations Principles for Sustainable Insurance		
Forum per la Finanza Sostenibile		
Altro (specificare)		
Altro (specificare)		
Altro (specificare)		
Altro (specificare)		
<b>Agenzie di rating ESG</b>	<b>Utilizzo nelle valutazioni</b>	
ECPI / StatPro		
RobecoSAM / S&P		
Sustainalytics / Morningstar		
Vigeo-Eiris / Moody's		
Altro (specificare)		
Altro (specificare)		
Altro (specificare)		

4. Team di gestione, risk management e reporting

18. Responsabile e team dedicato alla Gestione del portafoglio

CV sintetico Responsabile della Gestione: Nome	Anni di esperienza nella Gestione di portafoglio	Anni in Società	Anni nel ruolo	Sede di lavoro (città)
<b>Esperienza Lavorativa: Ruolo</b>	<b>Società</b>	<b>Dal</b>	<b>Al</b>	<b>Posizione manageriale</b>
<b>Formazione: descrizione titolo</b>	<b>Tipologia</b>	<b>Anno conseguimento</b>	<b>Conseguito presso</b>	<b>Luogo</b>
Indicare i principali elementi qualificanti della politica di remunerazione del responsabile della gestione (massimo 1000 caratteri).				
Se presenti, descrivere eventuali rating assegnati al Gestore da parte di società di valutazione specializzate (es. Citywire, Morningstar...)				
Portafogli simili gestiti alla data di pubblicazione del Bando (fornire se possibile ulteriori dettagli rispetto a tali portafogli in allegato .pdf)	Numero		Patrimonio (Mln €)	
<b>Team di Gestione del portafoglio (max 5 risorse con min 2 anni di esperienza, incluso il responsabile)</b>	<b>Ruolo nel mandato</b>	<b>Anni di esperienza nella Gestione di portafoglio</b>	<b>Anni in Società</b>	<b>Sede di lavoro (città)</b>
	<b>Responsabile della Gestione</b>			
<b>N.risorse</b>	<b>0</b>			

caratteri residui

1000

<b>20. Risk Manager: Nome</b>	<b>Anni di esperienza nel Risk Management</b>	<b>Anni in Società</b>	<b>Anni nel ruolo</b>	<b>Sede di lavoro (città)</b>
<b>Esperienza Lavorativa: Ruolo</b>	<b>Società</b>	<b>Dal</b>	<b>Al</b>	<b>Posizione manageriale</b>
<b>Formazione: Descrizione Titolo</b>	<b>Tipologia</b>	<b>Anno conseguimento</b>	<b>Conseguito presso</b>	<b>Luogo</b>

5. Track record

23a. Track record mandati segregati per investitori istituzionali Europei non captive* conformi	Mandato 1	Mandato 2	Mandato 3	Mandato 4	Mandato 5	Mandato 6	Mandato 7
Per il mandato segregato, indicare:							
Il nome del Cliente (la mancata indicazione comporta una penalizzazione)**							
la tipologia di Cliente (a pena di esclusione)							
la nazionalità del Cliente - Paese (a pena di esclusione)							
Indicare per il portafoglio: - il benchmark, specificando per ogni singolo indice che lo compone: peso e relativo ticker Bloomberg - obiettivi e limiti di rischio previsti (es. limite max di TEV)							
Data di avvio della gestione							
Il portafoglio è gestito secondo un approccio ESG?***							
In caso affermativo, specificare le modalità di implementazione di approccio ESG al portafoglio							
Il portafoglio è gestito dallo stesso team preposto alla gestione del mandato e dichiarato nella Sezione 4?***							
Illustrare ULTERIORI ELEMENTI di composizione del portafoglio, ritenuti utili al fine di consentire una verifica rispetto ai criteri di conformità previsti nella sezione (ove ritenuto necessario è possibile fornire pdf a parte).							

\* Escludere patrimoni gestiti per enti/società del Gruppo di appartenenza

\*\* In relazione al nome del Cliente per mandati segregati, la Stazione Appaltante si impegna a tenere il più rigoroso riserbo in ordine a qualsiasi dato, notizia o informazione fornita e l'utilizzo strettamente connesso alle finalità della presente procedura.

\*\*\* Si segnala che una risposta negativa a tali domande non implica l'esclusione del portafoglio presentato.

**Controllo di conformità: la mancata rispondenza comporterà l'esclusione del portafoglio**

<b>Portafoglio</b>	Mandato 1	Mandato 2	Mandato 3	Mandato 4	Mandato 5	Mandato 6	Mandato 7
- valorizzazione e rendicontazione effettuata a valori e criteri di mercato?							
- presenza di parametro di riferimento interamente espresso da indici di mercato? (non sono ammesse le cd. "ossessioni total return")							
- patrimonio non inferiore a 50 milioni di euro al 31 dicembre 2020?							
- i rendimenti rendicontati nelle successive tabelle sono computati al lordo di costi e fiscalità ed espressi in euro?							
- stile di gestione attivo?							
<b>Benchmark</b>	Mandato 1	Mandato 2	Mandato 3	Mandato 4	Mandato 5	Mandato 6	Mandato 7
- benchmark diversificato globalmente?							
- componente azionaria compresa tra il 20% e il 50%?							
- obbligazioni corporate High Yield e paesi emergenti non superiori al 20%?							
- azioni Paesi Emergenti non superiori al 10%?							

**Dati di performance**

Compilare la tabella di seguito riportata tenendo conto delle seguenti istruzioni:  
 - qualora il candidato gestisca più di 7 mandati segregati per clientela istituzionale conformi è necessario rendicontare i dati richiesti per tutti e soli i primi 7 portafogli ordinati per patrimonio decrescente a fine giugno 2020. In ipotesi il candidato gestisca meno di 7 mandati segregati per clientela istituzionale conformi è necessario rendicontare i dati richiesti per tutti i portafogli conformi;  
 - i rendimenti di portafoglio dovranno essere calcolati secondo la metodologia GPS, espressi in Euro, applicando il cambio ufficiale BCE (se espressi in altra valuta) ed in percentuale, fino alla seconda cifra decimale, al lordo di commissioni e fiscalità. I rendimenti dei benchmark (se richiesti) dovranno essere espressi in maniera coerente;  
 - volatilità e tev (se richieste) dovranno essere calcolate su dati di rendimento mensili ed espressi su base annua utilizzando un fattore di annualizzazione pari a 12 (ovvero radice quadrata di 12).

	Mandato 1	Bmk 1	Mandato 2	Bmk 2	Mandato 3	Bmk 3	Mandato 4	Bmk 4	Mandato 5	Bmk 5	Mandato 6	Bmk 6	Mandato 7	Bmk 7
<b>rendimento annuo (percentuale)</b>														
2017														
2018														
2019														
2020														
rend. annuo da gen. 17 - dic. 20														
rend. annuo da avvio gestione - dic. 20														
<b>Volatilità annua gen. 2017 - dic. 2020</b>														
<b>Tevo annua gen. 2017 - dic. 2020</b>														
<b>Aum (Min 6) a fine periodo</b>														
2017														
2018														
2019														
dic. 2020														
<b>Composizione del portafoglio al 31 dicembre 2020</b>														
% liquidità e strumenti monetari														
% obbligazionario governativo														
% obbligazionario societario (inclusivo di titoli cartolarizzati)														
% azionario														
% altri investimenti														
numero titoli														
rating medio portafoglio obbligazionario														
duration media portafoglio obbligazionario														
rendimento a scadenza medio portafoglio obbligazionario														
% titoli di debito area Euro (su tot ptf)														
% titoli di debito area non Euro (su tot ptf)														
% titoli di debito Paesi Emergenti (su tot ptf)														
% titoli di debito HY (su tot ptf)														
% titoli di debito cartolarizzati (su tot ptf)														
% titoli di capitale area Euro (su tot ptf)														
% titoli di capitale area non Euro (su tot ptf)														
% titoli di capitale Paesi Emergenti (su tot ptf)														
% esposizione valutaria netta non euro (su tot ptf)														

**Indicare di seguito i rendimenti su base mensile**

	Mandato 1	Bmk 1	Mandato 2	Bmk 2	Mandato 3	Bmk 3	Mandato 4	Bmk 4	Mandato 5	Bmk 5	Mandato 6	Bmk 6	Mandato 7	Bmk 7
serie storica (rend. mensile) ▼														
serie storica (rend. mensile) ▼														
serie storica (rend. mensile) ▼														
serie storica (rend. mensile) ▼														
serie storica (rend. mensile) ▼														
serie storica (rend. mensile) ▼														
gen-17														
feb-17														
mar-17														
apr-17														
mag-17														
giu-17														
lug-17														
ago-17														
set-17														
ott-17														
nov-17														
dic-17														
gen-18														
feb-18														
mar-18														
apr-18														
mag-18														
giu-18														
lug-18														
ago-18														
set-18														
ott-18														
nov-18														
dic-18														
gen-19														
feb-19														
mar-19														
apr-19														
mag-19														
giu-19														
lug-19														
ago-19														
set-19														
ott-19														
nov-19														
dic-19														
gen-20														
feb-20														
mar-20														
apr-20														
mag-20														
giu-20														
lug-20														
ago-20														
set-20														
ott-20														
nov-20														
dic-20														

23b. Track record OICR/SICAV Ucits conformi	OICR/SICAV Ucits 1	OICR/SICAV Ucits 2	OICR/SICAV Ucits 3
Per FOICR/SICAV Ucits, indicare:			
Nome (inclusivo della tipologia di classe rendicontata)			
Isin della classe rendicontata (a pena di esclusione)*			
Indicare per il portafoglio: - il benchmark, specificando per ogni singolo indice che lo compone: peso e relativo ticker Bloomberg - obiettivi e limiti di rischio previsti (es. limite max di TEV)			
Data di avvio della gestione			
Il portafoglio è gestito secondo un approccio ESG?*			
In caso affermativo, specificare le modalità di implementazione di approccio ESG al portafoglio			
Il portafoglio è gestito dallo stesso team preposto alla gestione del mandato e dichiarato nella Sezione 4?*			
Illustrare ULTERIORI ELEMENTI di composizione del portafoglio, ritenuti utili al fine di consentire una verifica rispetto ai criteri di conformità previsti nella sezione (fornire pdf a parte).			

\* Necessario rendicontare, se disponibile, la classe istituzionale in euro

\*\* Si segnala che una risposta negativa a tali domande non implica l'esclusione del portafoglio presentato.

**Controllo di conformità: la mancata rispondenza comporterà l'esclusione dell'OICR**

OICR	OICR/SICAV Ucits 1	OICR/SICAV Ucits 2	OICR/SICAV Ucits 3
- valorizzazione e rendicontazione effettuata a valori e criteri di mercato?			
- OICR UCITS compliant?			
- presenza di parametro di riferimento interamente espresso da indici di mercato? (non sono ammesse le cd. "gestioni total return")			
- patrimonio non inferiore a 200 milioni di euro al 31 dicembre 2020?			
- i rendimenti rendicontati nelle successive tabelle sono computati al lordo di costi e fiscalità ed espressi in euro?			
- stile di gestione attivo/semi-attivo?			
<b>Benchmark</b>	Benchmark OICR 1	Benchmark OICR 2	Benchmark OICR 3
- benchmark diversificato globalmente?			
- componente azionaria compresa tra il 20% e il 50%?			
- obbligazioni corporate High Yield e paesi emergenti non superiori al 20%?			
- azionario Paesi Emergenti non superiori al 10%?			

**Dati di performance**

Compilare la tabella di seguito riportata tenendo conto delle seguenti istruzioni:  
 - qualora il candidato gestisca più di 3 OICR/Sicav Ucits conformi è necessario rendicontare i dati richiesti per tutti e soli i primi 3 portafogli ordinati per patrimonio decrescente a fine giugno 2020. In ipotesi il candidato gestisca meno di 3 OICR/Sicav Ucits conformi è necessario rendicontare i dati richiesti per tutti i portafogli.  
 - dovranno essere rendicontate le serie storiche di classi istituzionali denominate in euro; in assenza, altra classe disponibile i cui rendimenti dovranno essere convertiti in euro al cambio ufficiale BCE. Gli AuM dovranno essere riferiti alla somma di tutte le classi esistenti per il singolo OICR/Sicav Ucits  
 - i rendimenti di portafoglio dovranno essere calcolati secondo la metodologia GIPS, espressi in Euro, applicando il cambio ufficiale BCE (se espressi in altra valuta) ed in percentuale, fino alla seconda cifra decimale, al lordo di commissioni e fiscalità. I rendimenti dei benchmark (se richiesti) dovranno essere espressi in maniera coerente. Fornire in apposito allegato pdf i relativi factsheet a dicembre 2020.  
 - volatilità e tev (se richieste) dovranno essere calcolate su dati di rendimento mensili ed espressi su base annua utilizzando un fattore di annualizzazione pari a 12 (ovvero radice quadrata di 12).

	OICR/SICAV Ucits 1	Bmk 1	OICR/SICAV Ucits 2	Bmk 2	OICR/SICAV Ucits 3	Bmk 3
<b>rendimento annuo (percentuale)</b>						
2017						
2018						
2019						
2020						
rend. annuo da gen. 17 - dic. 20						
rend. annuo da avvio gestione - dic. 20						
<b>Volatilità annua gen. 2017 - dic. 2020</b>						
<b>TeV annua gen. 2017 - dic. 2020</b>						
<b>Aum (Min €) a fine periodo</b>						
2017						
2018						
2019						
2020						
<b>Total expense ratio (TER):</b>						
2017						
2018						
2019						
2020						
media annua da gen. 17 - dic. 20						
<b>Composizione del portafoglio al 31 dicembre 2020</b>						
% liquidità e strumenti monetari						
% obbligazionario governativo						
% obbligazionario societario (inclusivo di titoli cartolarizzati)						
% azionario						
% altri investimenti						
numero titoli						
rating medio portafoglio obbligazionario						
duration media portafoglio obbligazionario						
rendimento a scadenza medio portafoglio obbligazionario						
% titoli di debito area Euro (su tot ptf)						
% titoli di debito area non Euro (su tot ptf)						
% titoli di debito Paesi Emergenti (su tot ptf)						
% titoli di debito HY (su tot ptf)						
% titoli di debito cartolarizzati (su tot ptf)						
% titoli di capitale area Euro (su tot ptf)						
% titoli di capitale area non Euro (su tot ptf)						
% titoli di capitale Paesi Emergenti (su tot ptf)						
% esposizione valutaria netta non euro (su tot ptf)						

**Indicare di seguito i rendimenti su base mensile**

	OICR/SICAV Ucits 1	Bmk 1	OICR/SICAV Ucits 2	Bmk 2	OICR/SICAV Ucits 3	Bmk 3
<b>serie storica</b>	<b>serie storica</b>	<b>serie storica</b>	<b>serie storica</b>	<b>serie storica</b>	<b>serie storica</b>	<b>serie storica</b>
gen-17						
feb-17						
mar-17						
apr-17						
mag-17						
giu-17						
lug-17						
ago-17						
set-17						
ott-17						
nov-17						
dic-17						
gen-18						
feb-18						
mar-18						
apr-18						
mag-18						
giu-18						
lug-18						
ago-18						
set-18						
ott-18						
nov-18						
dic-18						
gen-19						
feb-19						
mar-19						
apr-19						
mag-19						
giu-19						
lug-19						
ago-19						
set-19						
ott-19						
nov-19						
dic-19						
gen-20						
feb-20						
mar-20						
apr-20						
mag-20						
giu-20						
lug-20						
ago-20						
set-20						
ott-20						
nov-20						



dic-20 | \_\_\_\_\_ | \_\_\_\_\_ | \_\_\_\_\_ | \_\_\_\_\_ | \_\_\_\_\_ | \_\_\_\_\_ |