

CASSA DI PREVIDENZA MONTE DEI PASCHI DI SIENA

PUBBLICA SOLLECITAZIONE DI OFFERTE PER LA SELEZIONE DI SOGGETTI A CUI
AFFIDARE L'INCARICO DI CUI ALL'ART. 7, D. LGS. N. 252/2005

Consiglio di Amministrazione del 27/04/2022. Il Bando è pubblicato per estratto sui quotidiani:

Il Sole 24 ORE e Milano Finanza

il 30/04/2022

1. Oggetto

Il Consiglio di Amministrazione della Cassa di Previdenza Monte dei Paschi di Siena (di seguito anche "Fondo" o "MPS"), iscritto con il numero 1127 all'Albo dei Fondi Pensione COVIP, nel corso della riunione 27.04.2022, ha deliberato di procedere alla selezione di un soggetto cui affidare l'incarico di cui all'art. 7 del D. Lgs n. 252/05 e successive modifiche ed integrazioni (s.m.i.).

Il soggetto incaricato (il Depositario) dovrà prevedere i seguenti servizi, distinti tra obbligatori ed aggiuntivi:

Servizi Obbligatori

- custodire le Risorse che compongono i Comparti;
- regolare le operazioni disposte dal Fondo ovvero dal Gestore/i incaricati;
- ricevere e trasmettere ordini di acquisto di quote di OICR;
- esercitare la funzione di sostituto d'imposta nei modi e tempi previsti dalla normativa vigente;
- controllare che l'attività svolta dai Gestori sia conforme alla Regolamentazione, nonché agli eventuali ulteriori vincoli e limiti di investimento a cui i Gestori devono attenersi, anche nella fase di pre-investimento prevista dalle convenzioni;
- valorizzare mensilmente i Comparti le cui Risorse sono depositate presso il Depositario o i Sub-Depositari;
- calcolare l'attivo netto (soft-NAV) di ciascuna rubrica/comparto su base giornaliera;
- predisposizione flussi informativi per alimentazione monitoraggio interno anche sulla base delle richieste dell'Autorità di Vigilanza, scomposizione ed anagrafiche portafogli per mandato e per Comparto, rendiconto dei costi di negoziazione, rendiconto operatività in derivati (anche OTC), calcolo del turnover ex disposizioni Covip, monitoraggio della qualità creditizia (dissesto finanziario) degli emittenti investiti dai Comparti, comunicazioni EMIR laddove necessarie;

Il Fondo valuterà inoltre, riservandosi la facoltà di affidamento, i seguenti Servizi Aggiuntivi:

- Clearing accentrato dei Derivati;
- Servizio di recupero di doppia tassazione (tax claim);
- Servizio di prestito titoli;
- Calcolo autonomo del Valore Quota Ufficiale della Cassa e Prospetto Nav Ufficiale;
- Applicativo di consultazione della composizione e valorizzazione dei Comparti aggiornato giornalmente;

il tutto in conformità alla normativa vigente.

2. Caratteristiche del Fondo

Gli attivi in gestione del Fondo al 31/12/2021 erano pari a oltre 0,65 Miliardi di Euro, con flusso contributivo annuo medio di 16mln ed un saldo previdenziale negativo medio di circa 40milioni di euro. La frequenza dei versamenti contributivi è di norma mensile. Gli iscritti al Fondo, alla data del 31/12/2021, sono ca. 5.900 unità.

Il Fondo è composto da massimo 5 comparti: Prudente, Attivo, Bilanciato, Dinamico e Integrativo che in sede di revisione della Politica di investimento attualmente in corso si ridurranno a 3.

Le principali caratteristiche del Fondo sono illustrate in Nota Informativa e Bilanci d'Esercizio disponibili sul sito web del Fondo: www.cassadiprevidenzamps.it.

3. Requisiti di partecipazione

Alla data di pubblicazione del presente Bando i soggetti candidati (di seguito "i Candidati" o, al singolare, "il Candidato") devono obbligatoriamente essere in possesso dei requisiti:

- a. di legge di cui all'art. 7 del D. Lgs. n. 252/2005 e s.m.i.;
- b. sede statutaria in un paese appartenente all'area U.E. con almeno una sede operativa in Italia;
- c. di fornire i servizi di Depositario per almeno 3 fondi pensione istituiti ai sensi dell'art. 3 del D. Lgs. n. 252/2005.

Ai sensi dell'art. 6, co. 6, D. Lgs. n. 252/2005 i soggetti interessati alla selezione non devono appartenere ad identici gruppi societari e comunque non devono essere legati, direttamente o indirettamente, da rapporti di controllo tra loro. A tutti i fini previsti dal presente Bando, per la determinazione del Gruppo si fa riferimento alle situazioni di controllo societario di cui all'articolo 2359 del codice civile.

Non saranno ammesse alla selezione le offerte di soggetti appartenenti a gruppi dei quali fa parte la società aggiudicataria dei servizi di gestione amministrativa e contabile del Fondo – Previnet (Service Amministrativo) o della Società di Revisione Legale dei conti (Deloitte & Touche S.p.A).

I suddetti requisiti risultano necessari ai fini dell'ammissibilità all'iter selettivo. I soggetti non in possesso dei surriferiti requisiti che presenteranno offerte saranno esclusi dalla selezione.

Ai Candidati è fatta esplicita richiesta di integrare i propri sistemi operativi ed i flussi dati in base alle procedure e agli applicativi in uso presso il Fondo Pensione, i Gestori Finanziari, il Service Amministrativo e l'Advisor. Con i suddetti soggetti, il Candidato assegnatario dell'incarico dovrà sottoscrivere uno specifico Service Level Agreement (SLA).

I soggetti interessati dovranno presentare la propria candidatura nei termini e con le modalità indicate nei successivi paragrafi.

4. Modalità di partecipazione

Per presentare la propria candidatura è richiesta la compilazione di un apposito Questionario, unitamente alla documentazione prevista al punto 6, e l'invio di un'Offerta economica.

Il Questionario è disponibile sul sito web del Fondo www.cassadiprevidenzamps.it, e dovrà essere compilato integralmente in ogni sua parte, in formato elettronico, rispettando tassativamente la sequenza e la scansione delle domande poste dal Questionario medesimo.

Eventuali quesiti riferiti alla compilazione del Questionario devono essere inoltrati esclusivamente al Fondo in forma scritta via e-mail al seguente indirizzo: cassaprevidenzamps@postacert.gruppo.mps.it entro e non oltre le ore 12.00 del 13/05/2022; il messaggio di posta elettronica dovrà recare in oggetto la dicitura: "CASSA DI PREVIDENZA MONTE DEI PASCHI DI SIENA – QUESITO SELEZIONE DEPOSITARIO".

5. Offerta economica

L'offerta economica, sottoscritta dal legale rappresentante del soggetto Candidato, dovrà essere contenuta in busta sigillata recante i riferimenti dell'offerente e la dicitura "CASSA DI PREVIDENZA MONTE DEI PASCHI DI SIENA– SELEZIONE DEPOSITARIO. Offerta Economica NON APRIRE" e deve contenere le seguenti voci:

- **Servizi Obbligator** - commissione omni-comprendiva espresse in percentuale annua da applicare al patrimonio per tutti i Servizi Obbligator di cui al punto 1 che precede, con frequenza di fatturazione trimestrale posticipata. La commissione offerta si intende unica e non indicizzata al: numero di comparti, gestori, numero di transazioni, valute, mercati di riferimento, classi di investimento, ivi comprese quelle cc.dd. alternative.
- **Tasso di interesse sulle giacenze di conto corrente in Euro** – espresso come spread (differenziale) in punti base (Bps) da applicarsi al tasso BCE di riferimento sui depositi presso la Banca Centrale.
- **Servizi Aggiuntivi** – espresse analiticamente per ciascun servizio in aliquota percentuale ovvero a cifra fissa a discrezione dell'offerente per Servizi Aggiuntivi di cui al punto 1 che precede.

6. Documentazione tecnica

La Documentazione Tecnica deve essere predisposta esclusivamente in formato elettronico, ed include, a pena di esclusione, i seguenti files:

- a. Questionario compilato in ogni sua parte, in formato pdf firmato dal legale rappresentante, con testo selezionabile ed abilitato alla copia;
- b. File excel relativi i dati di cui al Questionario, con testo selezionabile ed abilitato alla copia;
- c. Dichiarazione sottoscritta dal legale rappresentante o da altro soggetto munito dei necessari poteri che contenga:
 - dichiarazione di veridicità ed esaustività dei dati forniti;

- dichiarazione del possesso dei requisiti richiesti dalla legge e degli ulteriori requisiti di ammissione stabiliti nel Bando;
- dichiarazione di accettazione che l'eventuale convenzione sarà regolata esclusivamente dalla legge italiana e che per ogni eventuale controversia sarà competente il Foro di Siena;
- espressione del consenso al trattamento dei dati personali trasmessi. Si precisa che i dati forniti saranno trattati esclusivamente ai fini della partecipazione alla selezione di cui al presente Bando;
- una dichiarazione di disponibilità ad integrare i propri sistemi operativi in base alle procedure e agli applicativi in uso presso il Fondo e il/i Gestore/i Finanziario/i e il Service Amministrativo.

7. Documentazione da inviare per la candidatura

Al fine di sottoporre la propria candidatura, l'Offerente deve:

- inviare la Documentazione Tecnica per via telematica – a pena di esclusione - all'indirizzo di posta certificata cassaprevidenzamps@postacert.gruppo.mps.it entro e non oltre le ore 12.00 del 23/05/2022 recante il seguente oggetto: "CASSA DI PREVIDENZA MONTE DEI PASCHI DI SIENA – SELEZIONE DEPOSITARIO - INVIO CANDIDATURA".
- Inviare l'Offerta Economica, seguendo le indicazioni di cui al punto 5 che precede. Il plico - a pena di esclusione - deve pervenire presso la sede del Fondo Pensione Monte dei Paschi (Siena 53100, Viale Toselli 78) entro e non oltre le ore 12.00 del 23/05/2022 recante il seguente oggetto: "CASSA DI PREVIDENZA MONTE DEI PASCHI DI SIENA – SELEZIONE DEPOSITARIO. Offerta Economica – NON APRIRE". Il rischio del recapito oltre il termine sopra indicato grava sul mittente.

Ferme restando le responsabilità per la fornitura di informazioni non veritiere, si ricorda l'esistenza di possibili cause di esclusione derivanti dall'incoerenza delle informazioni fornite; la documentazione trasmessa e non espressamente richiesta non verrà presa in considerazione ai fini valutativi.

Sia la documentazione inviata telematicamente che quella inviata in formato cartaceo dovranno pervenire entro e non oltre il termine sopra indicato: la ricezione, entro il suddetto termine, della sola documentazione telematica ovvero, al contrario, della sola documentazione cartacea, rappresenterà motivo di esclusione della proposta. La non corretta o incompleta compilazione del Questionario e/o della documentazione richiesta, la presenza di errori formali o il mancato rispetto delle indicazioni fornite ad insindacabile giudizio del Fondo potranno essere motivo di esclusione della proposta del soggetto offerente, ferma in ogni caso la facoltà del Fondo di richiedere ai soggetti partecipanti, a proprio insindacabile giudizio, eventuali integrazioni della documentazione trasmessa ovvero conferma della validità e veridicità di informazioni ritenute rilevanti nella candidatura presentata a pena di esclusione dal processo.

L'intera documentazione dovrà essere redatta in lingua italiana.

8. Descrizione del processo di selezione

Il Fondo valuterà le offerte validamente pervenute in base ai seguenti principali aspetti, contenuti nel Questionario:

- assetto societario e struttura del Gruppo di appartenenza;
- struttura organizzativa, mezzi di supporto processi dedicati;
- struttura di controllo dei rischi e di compliance;
- tipologia della clientela e dimensione dei portafogli in custodia;
- copertura dei mercati internazionali;
- cyber risk.

Una volta esaminata la correttezza e la completezza delle offerte pervenute e assunto le conseguenti determinazioni, il Fondo Pensione procederà alla valutazione dei questionari pervenuti e delle offerte economiche.

Si precisa che solamente le candidature ritenute conformi al termine dell'attività di verifica saranno oggetto di valutazione, le altre saranno rigettate ed archiviate.

La procedura di selezione che si intende attuare, si fonda sulla: trasparenza, confrontabilità delle offerte e competizione tra candidati. La procedura è tesa a raggiungere la partecipazione di una significativa pluralità di soggetti rappresentativi del mercato di riferimento, ed a consentire il raggiungimento delle migliori condizioni qualitative, economiche e contrattuali per il Fondo.

Il Fondo MPS si riserva di richiedere ai candidati, a proprio insindacabile giudizio, eventuali integrazioni della documentazione trasmessa.

Il mancato rispetto di uno o più dei termini, delle modalità e delle condizioni di partecipazione alla selezione sopra indicati nonché di una o più delle prescrizioni redazionali contenute nel Questionario costituirà elemento di valutazione, da parte del Consiglio di Amministrazione, anche ai fini dell'esclusione del candidato dalla selezione.

A insindacabile giudizio del Fondo, l'individuazione del soggetto assegnatario sarà effettuata tramite apposita delibera di assegnazione da parte del Consiglio di Amministrazione, che sarà adottata unicamente dopo la definitiva determinazione delle condizioni economiche e solamente all'atto dell'accettazione, da parte del potenziale aggiudicatario, del testo della convenzione con conseguente conclusione del procedimento di selezione.

La convenzione dovrà prevedere, tra l'altro, le clausole di risoluzione e di recesso esercitabili dal Fondo con relativo proseguimento dell'attività fino alla individuazione di un nuovo Depositario. La convenzione sarà sottoposta alle leggi italiane e avrà durata quinquennale, con la facoltà di rinnovo per il Fondo.

In caso di mancato accordo per la sottoscrizione della convenzione, per qualsivoglia motivo, il potenziale aggiudicatario si intenderà rinunciatario e sarà escluso dal processo selettivo. In tale

evenienza, il Consiglio di Amministrazione potrà prendere in considerazione le migliori offerte in precedenza escluse e avviare nuove trattative con i soggetti riammessi, senza che ciò comporti forme di responsabilità precontrattuale. Anche in caso di rinuncia all'incarico da parte del soggetto aggiudicatario, o di successivo recesso del Fondo, il Consiglio di Amministrazione si riserva di riconsiderare le migliori candidature precedentemente escluse.

I contatti e le comunicazioni con i Candidati non potranno in alcun caso dare luogo a forme di responsabilità precontrattuale. Si ritiene utile precisare fin d'ora che tutte le comunicazioni scritte derivanti o comunque connesse all'attuazione della convenzione dovranno essere in lingua italiana.

Il presente annuncio costituisce invito ad offrire e non offerta al pubblico ex art. 1336 Cod. Civ. e non comporta per il Fondo alcun obbligo o impegno ad affidare i predetti servizi nei confronti degli eventuali offerenti e, per loro, alcun diritto a qualsiasi titolo, ivi inclusi, a titolo meramente esemplificativo, rimborsi di spese a qualsiasi titolo sostenute.

Si precisa che tutta la documentazione e le informazioni ricevute dal Fondo nell'espletamento della presente procedura di selezione saranno trattate come informazioni riservate e confidenziali, condivise con l'Advisor che supporta il Fondo nella selezione in oggetto, fermo restando che, in ogni caso, tutta la documentazione e le informazioni a qualsiasi titolo inviate e fornite nel corso dell'espletamento della procedura verranno mantenute ed acquisite dal Fondo. I dati personali contenuti nelle offerte saranno trattati in conformità alle disposizioni della vigente normativa privacy.

Siena, il 27/04/2022