

RICHIESTA DI OFFERTE PER IL RUOLO DI

1 ADVISOR ESG

Il Consiglio di Amministrazione del Fondo Pensione a contribuzione definita del Gruppo Intesa Sanpaolo (di seguito il "Fondo") ha deliberato di procedere alla selezione di un Advisor ESG (Environmental, Social and Governance) per l'implementazione delle proprie linee guida in tema di investimenti socialmente responsabili (SRI – Socially Responsible Investment) e per la fornitura di prodotti e servizi per l'integrazione di aspetti sociali, ambientali e di governance negli investimenti.

PREMESSA

Il "Fondo Pensione a Contribuzione Definita del Gruppo INTESA SANPAOLO" (di seguito anche il "Fondo") rientra tra le forme pensionistiche preesistenti di cui all'art. 20, D. Lgs. 252/2005.

Il Fondo è iscritto alla specifica sezione dell'Albo dei fondi pensione al n. 1222, ha sede legale in P.za P. Ferrari, 10, 20121 – Milano, cod. fisc. 96009640226, e sedi operative in Piazza degli Affari, 4, 20123 – Milano, Piazza S. Carlo, 156, 10121 – Torino.

Attualmente le risorse finanziarie del Fondo affidate in gestione ammontano complessivamente a circa 4.000 milioni di euro, a cui si aggiungono ulteriori 1.000 milioni di euro in gestione assicurativa tramite polizze di ramo I e V.

Il Fondo Pensione ha manifestato da tempo interesse nei confronti della responsabilità sociale applicata al proprio patrimonio investito e ha sottoscritto i Principi per l'Investimento Responsabile (Principles for Responsible Investment, PRI);

Si riportano di seguito le principali caratteristiche dei comparti finanziari che costituiscono il Patrimonio del Fondo:

Obbligazionario a breve termine

Le risorse del comparto sono investite in strumenti finanziari di natura obbligazionaria fino per il 95% del patrimonio in gestione e in strumenti finanziari di natura azionaria per il 5% del patrimonio in gestione.

I mandati sono articolati in:

- **3 mandati specialistici obbligazionari a breve termine (1-3 anni) parametrati a benchmark**, di cui:
 - 1 mandato governativo passivo a breve termine;

Soggetto con personalità giuridica
Iscritto all'Albo della COVIP con il n. 1222

- 1 mandato governativo attivo a breve termine per scelte dinamiche di duration e gestione del rischio «periferico» EMU;
- 1 mandato corporate attivo a breve termine per scelte dinamiche di posizionamento di «spread» creditizio;
- 1 mandato target risk principalmente cash e azionario (target risk 5%) total return.

Obbligazionario a medio termine

Le risorse del comparto sono investite in strumenti finanziari di natura obbligazionaria per il 70% del patrimonio in gestione e in strumenti finanziari di natura azionaria per il 20% del patrimonio in gestione.

I mandati sono articolati in:

- 3 mandati specialistici parametrati a benchmark, di cui:
 - 1 mandato governativo globale passivo a cambio coperto;
 - 1 mandato corporate globale attivo a cambio coperto per scelte dinamiche di posizionamento di «spread» creditizio;
 - 1 mandato azionario globale attivo a cambio aperto per la gestione dinamica del beta azionario e degli spread geografici/settoriali;
- 1 mandato target risk multi-asset a rischio controllato (3,5%) total return.

Bilanciato prudente

Le risorse del comparto sono investite in strumenti finanziari di natura obbligazionaria per il 60% del patrimonio in gestione e in strumenti finanziari di natura azionaria per il 40% del patrimonio in gestione.

I mandati sono articolati in:

- 3 mandati specialistici parametrati a benchmark, di cui:
 - 1 mandato governativo globale passivo a cambio coperto;
 - 1 mandato corporate globale attivo a cambio coperto per scelte dinamiche di posizionamento di «spread» creditizio;
 - 1 mandato azionario globale attivo a cambio aperto per la gestione dinamica del beta azionario e degli spread geografici/settoriali;
- 1 mandato target risk multi-asset a rischio controllato (5%) total return.

Bilanciato sviluppo

Le risorse del comparto sono investite in strumenti finanziari di natura obbligazionaria per il 50% del patrimonio in gestione e in strumenti finanziari di natura azionaria per il 35% del patrimonio in gestione.

I mandati sono articolati in:

- 3 mandati specialistici parametrati a benchmark, di cui:
 - 1 mandato governativo globale passivo a cambio coperto;
 - 1 mandato corporate globale attivo a cambio coperto per scelte dinamiche di posizionamento di «spread» creditizio;
 - 1 mandato azionario globale attivo a cambio aperto per la gestione dinamica del beta azionario e degli spread geografici/settoriali;
- 1 mandato target risk multi-asset a rischio controllato (5%) total return.

Azionario

Le risorse del comparto sono investite in strumenti finanziari di natura obbligazionaria per il 30% del patrimonio in gestione e in strumenti finanziari di natura azionaria per il 50% del patrimonio in gestione.

I mandati sono articolati in:

- 3 mandati specialistici parametrati a benchmark, di cui:
 - 1 mandato governativo globale passivo a cambio coperto;
 - 1 mandato corporate globale attivo a cambio coperto per scelte dinamiche di posizionamento di «spread» creditizio;

- 1 mandato azionario globale attivo a cambio aperto per la gestione dinamica del beta azionario e degli spread geografici/settoriali;
- 1 mandato target risk multi-asset a rischio controllato (7%) total return.

Finanziario Garantito

Le risorse del comparto sono distribuite in strumenti finanziari di natura obbligazionaria indicativamente per il 95% del patrimonio in gestione, con possibilità di investimento in obbligazioni corporate senior, e in strumenti di natura azionaria entro un limite massimo dell'8%.

All'Advisor ESG verranno richieste le seguenti attività, meglio specificate nell'apposito documento relativo all'oggetto dell'incarico:

- Analisi del portafoglio del Fondo alla luce dei criteri adottati nelle Linee guida del Fondo.
- Supporto nell'attività di engagement
- Supporto nel realizzare sinergie in ambito SRI con altri investitori istituzionali
- Supporto nella selezione di eventuali prodotti finanziari di natura socialmente responsabile
- Relazione annuale contenente i principali sviluppi in materia di investimenti socialmente responsabili presenti sul mercato finanziario con focus particolare sui fondi pensione europei
- Consulenza rispetto alle richieste del Fondo in materia di investimenti socialmente responsabili.

Il Fondo Pensione si riserva di utilizzare un fornitore dedicato per l'attività di determinazione del rating o score ESG degli emittenti presenti nei propri portafogli. Pertanto i candidati alla presente selezione dovranno essere in grado di utilizzare le valutazioni di soggetti terzi quali, ad esempio, Agenzie di Rating sulla Sostenibilità (SRA).

L'attività di Advisor ESG è incompatibile con quelle di gestore finanziario e di controllo interno del Fondo.

Saranno prese in considerazione solo le offerte provenienti da soggetti in possesso dei seguenti requisiti:

- Indipendenza da gruppi finanziari ed assicurativi
- Asset Under Advisement (AUA) minimo € 3 mld di Fondi Pensione/Casse di Previdenza/Fondazioni italiane/europee
- Presenza di almeno due consulenti dedicati di lingua italiana

Non saranno prese in considerazione le offerte presentate da persone fisiche o da liberi professionisti senza adeguata struttura organizzativa.

L'interazione con il Fondo, sia scritta che orale, dovrà essere effettuata sempre in lingua italiana.

L'incarico decorrerà dal 01/07/2018; avrà la durata di un anno e sarà eventualmente rinnovabile; le Parti si impegneranno a riunirsi prima della scadenza del contratto al fine di concordare l'eventuale rinnovo dello stesso.

I soggetti interessati sono invitati a presentare la propria candidatura, redatta in lingua italiana, compilando il Questionario tecnico che dovrà essere richiesto all'indirizzo FPISP.Investimenti@intesasanpaolo.com.
Le candidature dovranno pervenire in busta chiusa, con tutta la documentazione richiesta salvata in formato elettronico (.pdf) all'interno di un supporto di memorizzazione USB, a pena di esclusione entro e non oltre le ore 12:00 del giorno 11/05/2018 presso la sede operativa del Fondo al seguente indirizzo:

Fondo Pensione a contribuzione definita del Gruppo Intesa Sanpaolo
P.za S. Carlo, 156, 10121 – Torino
c.a. sig. Massimo Corsini – Oggetto SELEZIONE ADVISOR ESG

tramite consegna a mano, corriere o raccomandata a/r.

Non è necessaria la presentazione di un'offerta economica, in quanto questa verrà richiesta ai candidati che saranno ammessi alla successiva fase di audizione. L'offerta economica dovrà essere presentata indicando separatamente il compenso relativo all'attività di determinazione del rating o score ESG degli emittenti.

La presente richiesta costituisce invito ad offrire e non offerta al pubblico ex art. 1336 c.c.. La presente richiesta e la ricezione dell'eventuale offerta non comportano per il Fondo alcun obbligo o impegno nei confronti degli offerenti e, parimenti, nessun diritto, a qualsiasi titolo, è loro riconosciuto. Le offerte saranno valutate ad insindacabile giudizio dell'organo di amministrazione del Fondo.

Milano, 23 aprile 2018